Schroders

Schroder GAIA Geprüfter Jahresbericht 30. September 2021 Deutschland





Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Geprüfter Jahresbericht

30. September 2021

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.

Jahres- und Halbjahresberichte, der aktuelle ausführliche Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen und die Satzung der Gesellschaft sind kostenlos in Papierform am eingetragenen Sitz der Gesellschaft in 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Großherzogtum Luxemburg und bei sind auf www.eifs.lu/schroders verfügbar.

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

Schroders

Inhalt

Schroder GAIA	5
Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland	6
Verwaltungsrat	7
Verwaltung	8
Bericht des Verwaltungsrats	10
Bericht des Anlageverwalters	11
Prüfbericht	13
Nettovermögensaufstellung	16
Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021	26
Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021	28
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	30
Anlageportfolio	34
Schroder GAIA BlueTrend	34
Schroder GAIA Cat Bond	34
Schroder GAIA Contour Tech Equity	39
Schroder GAIA Egerton Equity	39
Schroder GAIA Helix	40
Schroder GAIA Oaktree Credit*	45
Schroder GAIA Sirios US Equity	49
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	50
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	51
Schroder GAIA Wellington Pagosa	52
Anmerkungen zum Abschluss	63
Gesamtkostenquote ("TER")	144
Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)	146
Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	148
Anhang III - Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)	159

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



Schroder GAIA

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 betrifft das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2020 bis zum 30. September 2021. Der Abschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Der letzte Termin, an dem die Anteilskurse berechnet wurden, war der 30. September 2021, der letzte Arbeitstag im Berichtsjahr. Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen zehn Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die "Teilfonds").

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

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

Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

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

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland

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

HSBC Continental Europe, Luxembourg 16, Boulevard d'Avranches L-2014 Luxemburg Email: simeudealing@schroders.com

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

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

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

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

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

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

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

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- Eric Bertrand

Head of Schroders GAIA

Vaults 13-16 Valletta Waterfront FRN 1914 Malta

Andere Verwaltungsratsmitglieder

Carla Bergareche

Head of Iberian Business

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

- Mike Champion

Head of Product Development

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

- Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini

Independent Director

12, rue de la Sapinière, 8150 Bridel Großherzogtum Luxemburg

- Bernard Herman

Independent Director

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

- Achim Kuessner

Country Head Germany, Austria & CEE

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

- Hugh Mullan

Independent Director

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg Großherzogtum Luxemburg

- Neil Walton

Head of Investment Solutions

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

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Registerund Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg Großherzogtum Luxemburg

Hauptzahlstelle und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxemburg

16, boulevard d'Avranches, 1160 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, 1470 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

BennBridge Ltd.

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

Contour Asset Management, LLC

99 Park Avenue, Suite 1540, New York, NY 10016 USA

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Egerton Capital (UK) LLP

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

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

- Egerton Capital (US), LP.

Oaktree Capital Management, L.P.

333 S Grand Ave, 28th Floor, Los Angeles CA 90071

Schroder GAIA Oaktree Credit*

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

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

1 London Wall Place, London EC2Y 5AU Vereinigtes Königreich

Schroder GAIA Helix Schroder GAIA M&A*

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

- BennBridge Ltd.
- Schroder Investment Management North America Ltd.
- Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

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

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

Two Sigma Advisers LP

100 Avenue of the Americas, 16th Floor, New York, NY 10013 USA

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

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



Verwaltung (Forts.)

Anlageverwalter (Forts.)

Wellington Management International Limited Cardinal Place, 80 Victoria Street, London SW1E 5JL

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

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

- Wellington Management Company LLP.

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 vor.

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

Zum 30. September 2021 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5.674.359.712 EUR, was im Vergleich zu 4.869.786.470 EUR zum 30. September 2020 einem Anstieg von 16,52 % entspricht.

1. Neue Teilfonds

Im Berichtsjahr wurden 2 neue Teilfonds für Kapitalanlagen innerhalb der Gesellschaft zur Verfügung gestellt:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA M&A	USD	29. Januar 2021
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	12. Mai 2021

2. Neue Anteilsklassen

Zusätzlich zu den 24 in den vorstehend aufgeführten Teilfonds zum jeweiligen Auflegungsdatum aufgelegten Anteilsklassen wurden während des Berichtsjahres außerdem folgende Anteilsklassen neu angeboten:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA BlueTrend			
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	USD	USD	21. Januar 2021
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	10. Juni 2021
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	USD	11. Dezember 2020
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	USD	29. Januar 2021

3. Auflösung von Teilfonds

Während des Berichtsjahres wurde ein Teilfonds aufgelöst:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA M&A	USD	28. April 2021

4. Auflösungen von Anteilsklassen

Zusätzlich zu den 12 Anteilsklassen im vorstehend genannten aufgelösten Teilfonds wurde während des Berichtsjahres außerdem folgende Anteilsklasse aufgelöst:

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

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA 30. September 2021

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

Der zwölfmonatige Berichtszeitraum begann mit einer ermutigenden Wende in der Covid-19-Pandemie, nachdem im November 2020 die Entdeckung erfolgreicher Impfstoffe gemeldet worden war. Ein weiteres wichtiges Ereignis, das ebenfalls im November stattfand, war die US-Präsidentschaftswahl, die der demokratische Kandidat Joe Biden für sich entscheiden konnte. Auch bei der Stichwahl für die Senatorenposten für den US-Bundesstaat Georgia errangen die Demokraten im Januar einen Sieg, so dass die Partei nun das Weiße Haus, den Senat und das Repräsentantenhaus kontrolliert.

Der deutliche Wahlsieg der Demokraten ebnete den Weg für umfangreiche fiskalpolitische Anreizmaßnahmen. Im März wurde ein 1,9 Bio. USD schweres Coronavirus-Rettungspaket verabschiedet, das die wirtschaftliche Erholung vom pandemiebedingten Abschwung beschleunigen soll.

Neben den Konjunkturmaßnahmen waren es vor allem die in den meisten Industrieländern zeitnah eingeleiteten Impfkampagnen, die eine Wiedereröffnung und Erholung der Wirtschaft ermöglichten. Nachdem unter den großen Wirtschaftsländern anfänglich die USA und das Vereinigte Königreich bei den Impfquoten die Führung übernommen hatten, gelang es Europa und Japan bis Ende des Sommers, zu ihnen aufzuschließen.

Während sich die Nachfrage weltweit erholte, kamen die Lieferketten zunehmend unter Druck. Dies führte zu einer weitläufigen Halbleiterknappheit, die die Automobilindustrie zu Produktionskürzungen zwang. Die hohe Nachfrage nach Waren führte zu einem enormen Preisanstieg bei Schiffscontainern, während sich der Arbeitskräftemangel in weiten Teilen Europas auf das Transportgewerbe auswirkte, wobei das Vereinigte Königreich besonders hart getroffen wurde. Verschärft wurde die Situation durch Covid-19-Ausbrüche, die wichtige Fertigungsregionen und Häfen in Asien heimsuchten. Besonders hart wurde Vietnam getroffen.

Engpässe in den Lieferketten trugen zu einem Anstieg der Inflation bei. In den USA lag die jährliche Inflationsrate in den letzten fünf Monaten des Berichtszeitraums oberhalb der Marke von 5 %. Da sich das annualisierte BIP-Wachstum im zweiten Quartal 2021 auf 6,7 % belief, drängte sich allmählich die Frage einer strafferen Geldpolitik auf. Die US-Notenbank ließ durchblicken, dass sie bis Ende des Jahres beginnen würde, ihr Programm zum Ankauf von Wertpapieren im Wert von 120 Mrd. USD pro Monat zurückzufahren. Gleichzeitig nahmen die Erwartungen zu, dass die US-Zinsen im Jahr 2022 angehoben werden dürften.

Zum Ende des Berichtszeitraums lösten steigende Energiepreise erneut einen Inflationsschub aus. Aufgrund eines knappen Erdgasangebots stiegen die Preise in Europa stark an, während sich China aufgrund von Kohleknappheit gezwungen sah, in mehreren Provinzen eine Stromrationierung einzuführen.

Auch hinsichtlich der Veränderung der aufsichtsrechtlichen Lage richtete sich das Augenmerk während des Zwölfmonatszeitraums vor allem auf China. Der erste Wirtschaftszweig, den die Regulierungsbehörden ins Visier nahmen, war der Finanztechnologiesektor, was eine Absage des geplanten Börsengangs der Ant Group gegen Ende des Jahres 2020 zur Folge hatte. Zu den übrigen Veränderungen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, zählten eine verschärfte Regulierung des breiteren Internetsektors sowie Maßnahmen zur Umwandlung des Markts für Nachhilfeleistungen in einen gemeinnützigen Sektor.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Globale Aktien erholten sich während des Berichtszeitraums stark, und der MSCI World Index rentierte mit 28,8 % (Quelle: DataStream). Auslöser hierfür waren anfänglich die enormen geld- und fiskalpolitischen Konjunkturmaßnahmen. Weitere positive Impulse lieferte dann gegen Ende des Jahres 2020 die Meldung, dass sich mehrere Impfstoffe als äußerst wirksam gegen Covid-19 erwiesen hatten.

Die globalen Aktienmärkte tendierten anschließend im Laufe des Jahres 2021 weiter aufwärts, was neben erfolgreichen Covid-19-Impfkampagnen in mehreren Regionen der Welt auch weiteren Konjunkturmaßnahmen zu verdanken war. Die Impfstoffmeldungen führten dazu, dass sich die niedrig bewerteten Teile des Marktes allmählich besser entwickelten, nachdem sie über mehrere Jahre hinweg eine Underperformance verzeichnet hatten. Zum Ende des Berichtszeitraums hatte der MSCI World Value Index eine Rendite von 31,7 % erzielt, verglichen mit 26,1 % für den MSCI World Growth Index (Quelle: DataStream).

Auf Sektorebene erzielten Energiewerte die mit Abstand stärkste Performance, und auch Finanzwerte (insbesondere Banken) verbuchten äußerst starke Renditen. Während des Jahres 2020 waren die Ölpreise drastisch eingebrochen, da die Nachfrage im Zuge der Stilllegung weiter Teile der Wirtschaft gesunken war. Die Wiedereröffnung der Wirtschaft trieb die Ölpreise im Jahr 2021 wieder in die Höhe.

Ganz ähnlich hatten Finanztitel im Jahr 2020 zu den Schlusslichtern gezählt. Insbesondere Banken waren durch Sorgen über mögliche Insolvenzen belastet worden, und einige Aufsichtsbehörden hatten Kapitalrückführungen an Aktionäre vorübergehend untersagt, um sicherzustellen, dass die Kapitalpolster der Banken ausreichen würden, um eine Krise zu bewältigen. Die befürchtete Insolvenzwelle blieb jedoch aus, sodass Banken in der Lage waren, ihre Dividendenzahlungen und Aktienrückkäufe wieder aufzunehmen.

Im Sektor für zyklische Konsumgüter verbuchten unterdessen Automobilfirmen besonders robuste Renditen, da sich die Nachfrage nach Autos stark erholte. Im IT-Sektor legten Halbleiterwerte deutlich zu, da die Nachfrage durch die rapide Digitalisierung der Weltwirtschaft angekurbelt wurde.

Zu den Sektoren, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, zählten die als "sichere Häfen" wahrgenommenen Bereiche des Marktes wie etwa Versorgung und Basiskonsumgüter, da Anleger diejenigen Marktsegmente bevorzugten, die empfindlicher auf den Konjunkturzyklus reagieren.

Aktien aus Schwellenländern erzielten starke Zugewinne, konnten jedoch nicht mit ihren Pendants aus den Industrieländern mithalten. Der MSCI EM Index verbuchte eine Rendite von 18,2 %. Die Underperformance war vor allem auf einen Abverkauf bei chinesischen Aktien zurückzuführen. Ausgelöst wurde die Marktschwäche anfänglich durch regulatorische Maßnahmen chinesischer Behörden. Verschärft wurde die Situation dann durch die neuerliche Auferlegung bestimmter Covid-19-Beschränkungen sowie die Störung von Lieferketten im August, gefolgt von Sorgen über potenzielle systemische Risiken für das Finanzsystem aufgrund der möglichen Insolvenz des Immobilienunternehmens Evergrande sowie Stromausfälle.

Unter den übrigen Schwellenländern zählte Russland aufgrund des Anstiegs der Öl- und Gaspreise während des Berichtszeitraums zu den Spitzenreitern. Taiwan und Korea verbuchten ebenfalls ordentliche Zugewinne, was nicht zuletzt der Nachfrage nach Halbleiter- und anderen Technologiewerten zu verdanken war.

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

Die starke konjunkturelle Erholung im Nachgang der Covid-19-Krise nahm an Fahrt auf und bot den Märkten Unterstützung, was neben den enormen geld- und fiskalpolitischen Konjunkturmaßnahmen auch der Ende 2020 gemeldeten Entwicklung von Covid-19-Impfstoffen zu verdanken war.

Die Impfkampagnen brachten Hoffnung auf eine Wiedereröffnung der Wirtschaft mit sich, was zusammen mit der Erwartung umfangreicher haushaltspolitischer Konjunkturprogramme in den USA die Stimmung aufhellte. Dies wiederum trieb im ersten Quartal 2021 die Wachstumsund Inflationserwartungen erheblich in die Höhe und löste damit einen deutlichen Anstieg der Renditen auf Staatsanleihen aus.

Da sich die Wirtschaft im Laufe des Jahres 2021 weiterhin stark erholte und die aufgestaute Nachfrage plötzlich freigesetzt wurde, kam erheblicher Inflationsdruck auf. Gleichzeitig mehrten sich die Fragen, wann die politische Unterstützung wohl zurückgefahren werden würde. Die weitläufig vertretene Meinung war nach wie vor, dass sich die Inflation als größtenteils vorübergehend erweisen würde.

Gegen Ende des Berichtszeitraums schwächte sich die Dynamik der Konjunkturerholung allmählich ab, obwohl der Inflationsdruck bestehen blieb. Im September schwenkten die US-Notenbank (Fed) und die Bank of England (BoE) auf eine restriktivere Geldpolitik um.

Über das Jahr hinweg stieg die Rendite auf zehnjährige US-Staatsanleihen von 0,69 % auf 1,49 %. Im ersten Quartal legte sie um rund 80 Basispunkte (Bp) zu und erreichte einen Stand von 1,78 %. Ab Ende März ging sie aufgrund von Anzeichen auf eine Abkühlung der Dynamik der wirtschaftlichen Erholung jedoch wieder zurück. Im September stiegen die Renditen, als die Fed auf eine etwas restriktivere Geldpolitik umschwenkte und durchblicken ließ, dass sie schon im November beginnen könnte, ihre Wertpapierkäufe zu drosseln.

Die Renditen auf zehnjährige britische Staatsanleihen stiegen von 0,23 % auf 1,02 %. Dies spiegelte eine schnelle Verbesserung des Konjunkturausblicks wieder, da es dem Vereinigten Königreich besonders gut gelang, sich große Mengen an Covid-19-Impfstoffen zu sichern und diese zeitnah zu verabreichen.

Die europäischen Renditen legten im ersten Quartal weniger stark zu, da die Sorgen über Covid-19 erhöht blieben und Impfkampagnen der Region anfänglich nur langsam anliefen. Im April und Mai stiegen die Renditen, da bei der Verabreichung von Impfstoffen Fortschritte erzielt wurden und die wirtschaftliche Erholung an Fahrt aufnahm. In der Folge gaben sie allerdings wieder nach. Die Renditen auf zehnjährige deutsche Staatsanleihen stiegen von -0,52 % auf -0,19 %. Die Renditen zehnjähriger italienischer Titel blieben unverändert bei 0,86 %.

Unternehmensanleihen erzielten positive Renditen und übertrafen die Wertentwicklung ihrer staatlichen Pendants. Investment-Grade-Titel verbuchten für das Jahr eine Gesamtrendite von 1,6 % (in Lokalwährung). Hochzinsanleihen legten um 10 % zu (Quelle: ICE Data Indices). US-Hochzinsanleihen aus dem Energiesektor verzeichneten einen starken Aufschwung, während sich Sektoren, die stark durch Covid-19 in Mitleidenschaft gezogen worden waren, gut erholten.

Ausblick

Die Wiedereröffnung der Weltwirtschaft setzt sich fort, und die Wirtschaftstätigkeit hat deutlich zugenommen. Die Stärke der Erholung hat viele Firmen jedoch auf dem falschen Fuß erwischt, und die Lieferketten sind überlastet, was zu einem Anstieg der Inflation geführt hat. Die Wirtschaftsexperten von Schroders rechnen weiterhin mit einer robusten Erholung der Weltwirtschaft. Tendenziell hat sich die Prognose allerdings in Richtung Stagflation bewegt, da die Wachstumsdynamik nachlässt und der Preisdruck steigt.

Das Team rechnet für 2021 mit einem weltweiten Wachstum von 5,9 %, gefolgt von einer Abkühlung auf 4,5 % im Jahr 2022. Die Prognose für die globale Inflation beläuft sich auf 3,1 % im Jahr 2021 bzw. auf 2,8 % im Jahr 2022. Das Team geht davon aus, dass die US-Notenbank ihre Leitzinsen bis Ende des Jahres 2022 anheben wird.

Was die einzelnen Anlageklassen betrifft, sollten Aktien durch ein robustes Ertragswachstum gestützt werden, das die Auswirkungen höherer Anleiherenditen mehr als ausgleichen dürfte. Innerhalb des Aktiensegments erscheint der Markt in Europa ohne das Vereinigte Königreich gut aufgestellt, um von einem relativ starken Wirtschaftswachstum zu profitieren, was neben den erfolgreichen Impfkampagnen auch der geldpolitischen Unterstützung durch die Europäische Zentralbank zu verdanken ist. Da der Aktienindex zyklischen Charakter hat, ist er auch bestens positioniert, um von einer Erholung der Weltwirtschaft zu profitieren. US-amerikanische Aktien sollten ebenfalls durch die Gewinne der Unternehmen gestützt werden. Allerdings sind ihre Bewertungen im historischen Vergleich sowie gegenüber den Titeln anderer Regionen sehr hoch.

Der Ausblick für Rentenwerte gestaltet sich schwieriger. Die Stärke der zyklischen Dynamik hat zwar abgenommen, der Höchststand der weltweiten Liquidität scheint inzwischen jedoch hinter uns zu liegen.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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



Prüfbericht



Prüfbericht

An die Anteilsinhaber von **Schroder GAIA**

Unser Prüfungsurteil

Unseres Erachtens zeigt der beiliegende Jahresabschluss ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Finanzlage des Schroder GAIA (der "Fonds") und jedes seiner Teilfonds zum 30. September 2021 sowie ihrer Betriebsergebnisse und Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr im Einklang mit den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Jahresabschlusses.

Umfang unserer Prüfung

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2021;
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung für das abgelaufene Geschäftsjahr;
- · die Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr;
- das Anlageportfolio zum 30. September 2021; und
- die Anmerkungen zum Abschluss, die einen Überblick über die wesentlichen Rechnungslegungsmethoden enthalten.

Grundlage des Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung im Einklang mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über das Prüfungswesen (Gesetz vom 23. Juli 2016) und den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing, ISAs), die von der "Commission de Surveillance du Secteur Financier" (CSSF) für Luxemburg übernommen wurden, durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs sind im Abschnitt "Verantwortung des "Réviseur d'entreprises agréé" für die Prüfung des Abschlusses" unseres Berichts näher ausgeführt.

Unseres Erachtens sind die Ergebnisse aus unserer Prüfung ausreichend und geeignet, um als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk zu dienen.

Wir sind im Einklang mit dem von der CSSF für Luxemburg übernommenen "International Code of Ethics for Professional Accountants (including International Independence Standards)" des International Ethics Standards Board for Accountants (IESBA Code) zusammen mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses gelten, unabhängig vom Fonds. Wir haben unsere sonstigen ethischen Verantwortlichkeiten im Rahmen dieser ethischen Anforderungen erfüllt.

Sonstige Angaben

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Angaben verantwortlich. Die sonstigen Angaben umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Angaben, jedoch nicht den Jahresabschluss und unser Prüfungsurteil zu diesem Jahresabschluss.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxemburg T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, www.pwc.lu

 $Cabinet\ de\ r\'evision\ agr\'e\'e.\ Expert-comptable\ (autorisation\ gouvernementale\ n°10028256)$

Prüfbericht (Forts.)



In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses liegt es in unserer Verantwortung, die vorstehend identifizierten sonstigen Angaben zu lesen und dabei zu erwägen, ob die sonstigen Angaben wesentliche Widersprüche zum Abschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erworbenen Kenntnisse enthalten oder anderweitig wesentlich fehlerhaft zu sein scheinen. Wenn wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeit feststellen, dass diese sonstigen Angaben wesentliche Falschaussagen enthalten, sind wir verpflichtet, dies zu berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss

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

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

Verantwortung des "Réviseur d'entreprises agréé" für die Prüfung des Abschlusses

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

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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher Falschaussagen im Abschluss aufgrund von Betrug oder Irrtum, wir konzipieren auf diese Risiken ausgerichtete Prüfungsverfahren und führen diese durch und wir verschaffen uns Prüfungsnachweise, die als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk ausreichend und geeignet sind. Das Risiko, dass eine auf Betrug zurückzuführende wesentliche Falschaussage nicht aufgedeckt wird, ist höher als im Fall von Irrtümern, da im Betrugsfall Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, Falschdarstellungen oder das Ausschalten interner Kontrollmaßnahmen vorliegen können;
- verschaffen wir uns ein Verständnis der für die Prüfung relevanten internen Kontrollmaßnahmen, um Prüfverfahren zu konzipieren, die für die jeweilige Situation geeignet sind, jedoch nicht zum Zweck der Äußerung einer Ansicht darüber, ob die internen Kontrollmaßnahmen des Fonds wirksam sind oder nicht;
- beurteilen wir die Eignung der verwendeten Rechnungslegungsmethoden und die Angemessenheit der rechnungslegungsbezogenen Schätzungen und der diesbezüglichen Angaben des Verwaltungsrats des Fonds;

Prüfbericht (Forts.)



- äußern wir uns zur Angemessenheit der Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung durch den Verwaltungsrat des Fonds und dazu, ob auf der Grundlage der Ergebnisse der Prüfung eine erhebliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fortführung des Fonds oder eines seiner Teilfonds erheblich in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfungsbericht auf die entsprechenden Angaben im Abschluss aufmerksam zu machen oder unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, wenn diese Angaben unzulänglich sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Ergebnissen aus unserer Prüfung bis zum Datum unseres Prüfungsberichts. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds nicht fortgeführt wird;
- beurteilen wir die allgemeine Darstellung, die Struktur und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Offenlegungen, und wir beurteilen, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse angemessen darstellt.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative Vertreten durch

Luxemburg, 26. Januar 2022

Karim Bara

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE					
Anlagen					
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	139.531.492	2.291.292.410	378.600.470	733.799.714	612.348.065
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	7.537.036	(2.063.938)	20.168.614	179.643.229	40.615.192
Wertpapiere zum Marktwert	147.068.528	2.289.228.472	398.769.084	913.442.943	652.963.257
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)					
aus Devisenterminkontrakten	(2.266.829)	(18.228.179)	(2.589.672)	(12.618.190)	(7.820.668)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	(813.881)	-	-	3.390.249	3.178.814
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	14.126.360	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	(2.260.994)	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	31.558.010	28.015.261
aus Differenzkontrakten	(460.819)	-	13.313.355	-	(19.407.895)
	8.323.837	(18.228.179)	10.723.683	22.330.069	3.965.512
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	2.241.245	327	5.500.817	4.443.043	30.186.814
Bankguthaben	29.765.790	82.076.974	22.306.357	5.620.566	57.752.113
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	11.554.168	3.683.959
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	21.323.650	_	20.579.251	17.037.355	2.201.504
Forderungen aus Zeichnungen	565.562	7.208.976	1.374.625	298.486	79.901.795
Optionen und Swaptions zum Marktwert	_	_	_	_	876.606
Dividenden und Zinsforderungen	642.028	16.826.912	211.689	789.276	5.845.737
Erstattungsforderung des Fonds	96.398	_	_	_	30.883
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen					
auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen	1.700.000	16.990.000	2.070.000	-	4.580.000
mit Währungsabsicherung					
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf					
Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit	100.000	-	-	1.790.000	-
Währungsabsicherung		547.046		100.010	
Sonstige Forderungen	-	517.946	-	189.319	-
SUMME VERMÖGENSWERTE	211.827.038	2.394.621.428	461.535.506	977.495.225	841.988.180
VERBINDLICHKEITEN	454477	7 477 024	6 220 450	7.066.056	00 707 467
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	154.177	7.477.934	6.228.458	7.866.956	98.707.467
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Anteilen	34.116	616.147	1.102.089	5.081.434	947.024
Fällige Managementgebühren	194.515	1.881.226	489.056	1.135.403	263.816
Fällige Performancegebühren	603.261	-	6.907.142	10.201.533	4.775.314
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	1.222	-	2.476.771	372.273	566.729
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	2.574.897	2 560 000	-	-	-
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	_	3.560.000	-	-	_
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf				1 700 000	
Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	_	-	1.780.000	_
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf					
Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit	1.800.000	16.990.000	2.070.000	10.000	4.580.000
Währungsabsicherung	1.000.000	10.990.000	2.070.000	10.000	500.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	374.510	1.056.596	558.630	1.582.609	614.929
SUMME VERBINDLICHKEITEN	5.736.698	31.581.903	19.832.146	28.030.208	110.455.279
SUMME NETTOVERMÖGEN	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901

VERMÖGENSWERTE Anlagen Wertpapiere zu Anschaffungskosten Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust) Wertpapiere zum Marktwert Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Devisenterminkontrakten aus Kassageschäften aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten aus Credit Default Index-Kontrakten	28.425.881 (287.228) 28.138.653 139.162	273.910.195 35.636.459 309.546.654 (581.773)	245.041.831 111.036 245.152.867 (5.685.407)	28.303.089 591.686 28.894.775	296.961.552 16.931.435	4.449.643.415
Wertpapiere zu Anschaffungskosten Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust) Wertpapiere zum Marktwert Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Devisenterminkontrakten aus Kassageschäften aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten	(287.228) 28.138.653	35.636.459 309.546.654 (581.773)	111.036 245.152.867	591.686	16.931.435	4.449.643.415
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust) Wertpapiere zum Marktwert Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Devisenterminkontrakten aus Kassageschäften aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten	(287.228) 28.138.653	35.636.459 309.546.654 (581.773)	111.036 245.152.867	591.686	16.931.435	4.449.643.415
Wertpapiere zum Marktwert Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Devisenterminkontrakten aus Kassageschäften aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten	28.138.653	309.546.654 (581.773)	245.152.867			
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Devisenterminkontrakten aus Kassageschäften aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten		(581.773)		28.894.775		282.760.461
aus Devisenterminkontrakten aus Kassageschäften aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten			(5 685 407)		313.892.987	4.732.403.876
aus Kassageschäften aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten	139.162 - - -		(5 685 <u>4</u> 07)			
aus Terminkontrakten aus Credit Default Swap-Kontrakten	- - -	-	(3.003.407)	57.973	(955.485)	(45.346.414)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-		12.102	-	-	10.448
·	-	-	(12.295.479)	(25.200)	814.757	(4.508.697)
aus Credit Default Index-Kontrakten		-	-	-	12.784	11.036
	-	-	(90.184)	-	6.325	12.122.848
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(994.921)	(858.912)
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1.479.884	(674.330)
aus Total Return Swaps	-	6.648.949	(9.790.394)	-	(485.299)	52.612.542
aus Differenzkontrakten	-	-	-	72.353	-	(5.575.060)
	139.162	6.067.176	(27.849.362)	105.126	(121.955)	7.793.461
Forderungen aus dem Verkauf	447.000	10 707 101	100 674 470	00.500	00 400 407	101010015
von Wertpapieren	117.292	10.707.134	132.671.172	82.509	38.433.497	194.342.015
Bankguthaben	715.838	38.821.093	468.653.901	2.273.160	41.471.921	648.454.645
Termineinlagen	-	-	161.625.000	-	-	139.530.369
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	61.157.347	2 442 024	12.640.072	78.443.604
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	20.000	-	53.533.522	2.112.021	46.244.509	143.724.605
Forderungen aus Zeichnungen	-	161.339	59.999	42.642	8.110.447	84.368.711
Optionen und Swaptions zum Marktwert	222.676	2.210.525	- 22.000	42.642	3.921.620	6.100.235
Dividenden und Zinsforderungen	322.676	125.170	33.898	169.943	1.015.602	22.589.849
Erstattungsforderung des Fonds	_	-	-	-	_	109.881
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen	40.000	1.080.000	6.840.000		1.860.000	30.353.521
mit Währungsabsicherung	40.000	1.000.000	0.840.000	_	1.800.000	30.333.321
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf						
Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit	_	_	500.000	260.000	50.000	2.653.577
Währungsabsicherung						
Sonstige Forderungen	_	-	_	47.350	_	691.538
SUMME VERMÖGENSWERTE	29.493.621	368.719.091	1.102.378.344	33.987.526	467.518.700	6.091.559.887
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf						
von Wertpapieren	779.352	15.921.991	181.356.124	312.477	44.763.340	315.036.534
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme						
von Anteilen	-	2.416.710	724.666	76.485	111.590	10.309.041
Fällige Managementgebühren	4.094	454.860	1.176.199	20.032	418.465	5.373.519
Fällige Performancegebühren	-	1.737.458	-	1.035.559	7.568.768	30.046.360
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	699.521	628.142	49.568	690.316	4.800.545
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	2.222.901
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	7.310.000	-	-	-	9.384.038
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen				400.000		4 000 077
auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen	-	-	_	180.000	-	1.989.377
mit Währungsabsicherung						
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen	40.000	1 000 000	7 240 000	90,000	1.910.000	21 017 720
mit Währungsabsicherung	40.000	1.080.000	7.340.000	80.000	1.510.000	31.017.720
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	43.264	475.951	2.764.383	24.919	376.725	7.020.140
SUMME VERBINDLICHKEITEN	866.710	30.096.491	193.989.514	1.779.040	55.839.204	417.200.175
SUMME NETTOVERMÖGEN	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496	5.674.359.712

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung
als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2021 umgerechnet: 1 Euro = 1,15835 US-Dollar und
1 Euro = 0,85969 Pfund Sterling.

Nettoinventarwert	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
zum 30. September 2021	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901
zum 30. September 2020	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534
zum 30. September 2019	90.737.733	1.338.107.686	149.869.826	1.024.540.653	235.393.291
Im Umlauf befindliche Anteile**					
zum 30. September 2021					
Klasse A Thes.	32.279	1.163	265.966	462.817	18.480
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	100	-	4.120	_	511
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	447.014	_	57.496	_	108.579
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	11.365	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	_	100		-	_
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	100	-	5.342	-	140
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	396.027	-
Klasse A Aussch. GBP Klasse A1 Thes.	-	_	29.302	900 24.009	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	_	-	29.302	106.081	_
Klasse A2 Thes.	_	_	_	100.001	_
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	_	-
Klasse C Thes.	301.153	2.620	1.438.659	1.661.214	12.370
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	246.989	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	4.082	1.327	31.429	-	100
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	163.803	7.138	831.869	-	358.638
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	364.609	100	227.640	199.707	155.284
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	99.123	_	140
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	_	_	100	1.031.573	140
Klasse C Aussch.	_	_	_	5.802	_
Klasse C Aussch. GBP	_	_	_	9.767	_
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	185	_	_	-	_
Klasse C1 Thes.	_	_	_	_	1
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	2
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	2
Klasse E Thes.	84.090	-	23.447	1.475	525.100
Klasse E Thes. CHF	19	-	2.560	-	- -
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	128 5.000	_	2.569 54.362		52.001 998.676
Klasse E Thes. (III EOK abgesichert)	18	_	34.302	_	990.070
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	90	_	45.921	_	980.906
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	_	51.068	_	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	_	_	100	_	140
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	120.006	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	16.638	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	3.133	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	12.488	-	-	-
Klasse F Aussch. Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	_	162 477	-	_	-
Klasse I Thes.	15	152.255	15	14	1.564.534
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	26.914	-	-	1.504.554
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	_	9	_	_	_
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	_	120	_	_	103
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	65	_
Klasse IF Thes.	-	211.956	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	133.658	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	486.592	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	6.766.334	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	18.374	-	-	-
Klasse K Thes. Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)					
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	100	_	_	_	_
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1.250	_	_	_	_
Klasse R Thes.	-	_	_	_	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	_	_	_	_
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	356.400	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)					653.632

^{**} Informationen zu der für die Anteilsklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie im Abschnitt "Anteilsklassen" der Anmerkungen zum Abschluss.



	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 30. September 2021	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496
zum 30. September 2020 zum 30. September 2019	-	496.429.129 771.660.956	1.437.139.563 1.796.666.842	53.232.443 63.415.401	551.890.372 488.290.256
Im Umlauf befindliche Anteile**		771.000.950	1.790.000.042	03.413.401	466.290.230
zum 30. September 2021					
Klasse A Thes.	_	730.032	_	_	117.707
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	_	6.620	_	_	2.033
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	-	207.134	-	-	101.646
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	_	- 17.350
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	_	_	-	_	17.550
Klasse A Aussch. GBP	_	_	_	_	_
Klasse A1 Thes.	_	-	-	-	15
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	100 100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert) Klasse C Thes.	150	676.508	2.757.595	4.001	1.800.594
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	179.227
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	100	13.864	28.110	1.455	27.313
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	100	380.105	1.696.979	113.010	553.031
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	100	62.573	1.942.370	-	447.967
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert) Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	_	_	96
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	12.192	-
Klasse C Aussch.	_	_	_	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	-	3.104	-	-	-
Klasse C1 Thes. Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	_	-	-	_	1
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)		_	_	_	6 331
Klasse E Thes.	42.522	894	_	_	51.725
Klasse E Thes. CHF	_	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	15.582	-	-	-	10.867
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	18.534	24.191	-	-	149.840
Klasse E Thes. GBP Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	100	_	-	_	69.518
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	_	_	_	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	_	-	-	-	96
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert) Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse F Aussch.		_	_	_	_
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	_	_	_	_	-
Klasse I Thes.	200.015	15	15	15	15
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert) Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	_	_	-	_	-
Klasse IF Thes.	_	_	_	_	_
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	_	_	_	_
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. Klasse K Thes.	-	-	- 759.943	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	_	759.943 2.734	_	_
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	79.709	304	_
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	_	77	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	445 674	-
Klasse R Thes.	-	-	-	115.671 27.408	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	_	-	27.408 7.597	-
Klasse X Thes.	_	15	_		_
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	_	20.218	-	-	-

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

^{**} Informationen zu der für die Anteilsklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie im Abschnitt "Anteilsklassen" der Anmerkungen zum Abschluss.

Notto inventary vert is Antoilt's	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil** zum 30. September 2021					
Klasse A Thes.	104,27	1.467,46	132,18	220,80	115,45
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	90,88	-	121,95	-	109,23
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	93,88	_	124,41	_	110,04
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	206,94	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	913,91	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	142,43	-	181,62	218,87	114,68
Klasse A Aussch. GBP	_	_	_	210,98	_
Klasse A1 Thes.	_	_	131,99	207,06	_
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	210,90	_
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	107.00	1 476 56	126.52	227.01	110.46
Klasse C Thes. Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	107,08 105,88	1.476,56	136,52	237,81	118,46
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	93,82	1.160,58	127,56	_	112,83
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	96,05	1.221,98	128,16	_	113,22
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	102,06	104,90	105,55	221,12	115,81
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1.065,45	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	188,93	-	117,41
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	_	236,05	-
Klasse C Aussch. Klasse C Aussch. GBP	_	-	_	237,14 227,65	_
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	101,08	_	_	227,05	_
Klasse C1 Thes.	-	_	_	_	5.851,33
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	5.641,43
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	_	-	-	_	5.671,85
Klasse E Thes.	110,23	-	137,92	236,00	120,71
Klasse E Thes. CHF Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	96,45 94,54	-	- 128,05	_	- 114,22
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	98,76	_	129,31	_	115,35
Klasse E Thes. GBP	108,56	-	-	_	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	105,36	-	105,52	-	117,81
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1.065,91	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	10412	-	190,34	-	119,58
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert) Klasse F Thes.	104,12	- 1.466,48	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	_	1.155,70	_	_	_
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	_	1.214,16	_	_	_
Klasse F Aussch.	-	1.173,41	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1.569,30	-	-	-
Klasse I Thes.	121,74	1.662,84	157,11	341,27	125,92
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.407,79	-	-	-
Klasse I Thes. (in EOR abgesichert) Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	_	1.484,33 10.608,63	-	_	12.903,29
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	_	-	_	275,98	-
Klasse IF Thes.	_	1.514,07	_	-	_
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.281,57	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.351,44	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	922,66	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1.396,47	-	-	-
Klasse K Thes. Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-		-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	_	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	95,01	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	105,16	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	_	_
Klasse X Thes.	_	-	_	236,36	_
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)		_	_	_50,50	114,60

 $[\]hbox{\tt ** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der W\"{a}hrung der Anteilsklasse ausgewiesen. } \\$



	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil**					
zum 30. September 2021 Klasse A Thes.		151,88			110,83
Klasse A Thes. Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	_	181,00	_	_	102,32
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	_	136,50	_	_	103,28
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	_	_	_	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	152,54
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	100.20
Klasse A1 Thes. Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	_	109,29
Klasse A2 Thes.	101,37	_	_	_	_
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	100,89	_	_	_	_
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	101,01	-	_	_	_
Klasse C Thes.	101,56	158,46	114,81	116,22	113,26
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	_	_	_	_	116,73
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	101,09	187,13	103,24	146,22	104,63
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	101,21	142,29 148,13	105,29	131,06	105,57
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	101,46	148,13	109,54	_	86,96
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	_	_	_	_	155,95
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	154,88	-
Klasse C Aussch.	-	-	_	-	_
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	-	148,04	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.666,93
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	5.228,86
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert) Klasse E Thes.	101,53	169,60	-	_	5.284,23 115,46
Klasse E Thes. CHF	101,33	109,00	_	_	113,40
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	101,08	_	_	_	106,46
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	101,26	152,59	_	_	107,49
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	101,52	-	-	-	88,64
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	159,01
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert) Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	_	_	-	_	_
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse F Aussch.	_	_	_	_	_
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	101,84	205,53	133,89	123,90	121,92
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert) Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	_	_	_	_	_
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	_	_	_
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	112,18	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	100,80	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	102,70	128,06	-
Klasse K Thes. (in ELIP aboresichert)	-	-	-	151,95	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert) Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-		-	_
Klasse R Thes.	-	_	-	116,14	_
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	_	_	131,08	_
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	_	-	154,92	-
Klasse X Thes.	-	104,86	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	_	151,00			

^{*} Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.
** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

Nottoinvontarwort in Antail**	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil** zum 30. September 2020					
Klasse A Thes.	86,58	1.420,12	123,26	211,77	107,16
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	76,51 78,76	-	115,69 116,88	-	102,22 102,77
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	70,70	-	110,00	197,45	102,//
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	118,40	_	171,31	-	105,54
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	208,39	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	213,86	-
Klasse A1 Thes. Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	123,20	199,36 201,60	-
Klasse C Thes.	88,63	1.423,33	126,38	226,74	108,09
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-		-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	78,43	1.132,03	119,86	-	103,83
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	80,11	1.187,75	119,68	-	104,43
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	84,81	101,39	97,89	209,80	106,30
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	000 59	29.258,43	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert) Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	990,58 174,53	_	- 107,19
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	_	_	174,55	223,17	107,19
Klasse C Aussch.	-	_	_	226,00	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	229,37	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	84,95	-	-	-	
Klasse C1 Thes.	-	-	-	_	5.333,77
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert) Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	-	5.191,66 5.208,67
Klasse E Thes.	91,56	_	126,84	224,98	109,18
Klasse E Thes. CHF	79,53	_	_	_	_
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	79,92	-	119,03	-	104,69
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	82,36	-	119,96	-	105,46
Klasse E Thes. (in CRR abgresishert)	94,68	-	07.47	-	106.09
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	88,59 -	_	97,47 986,64	_	106,98
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	_	_	175,49	_	108,18
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	87,47	_	· -	_	-
Klasse F Thes.	-	1.418,48	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.130,75	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)		1.185,11	-	-	-
Klasse F Aussch. Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1.170,10 1.566,30	-	_	_ _
Klasse I Thes.	98,72	1.583,23	139,84	317,22	110,86
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.355,82	-		-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.426,13	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	10.145,79	-	-	11.409,09
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	1 450 67	-	254,12	-
Klasse IF Thes. Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	_	1.458,67 1.248,94	-	_	
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	_	1.313,54	_	_	_
Klasse IF Aussch.	-	1.392,31	_	_	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert) Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	- 87,63	-	_	_	-
Klasse R Thes.	07,03	-	_	-	_
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	_	_
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	-	_
Klasse X Thes.	-	-	-	225,24	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)					104,73

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



	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil** zum 30. September 2020				
Klasse A Thes.	125.15			102.20
Klasse A Thes. Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	135,15 162,66	-	-	102,30 94,81
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	122,38	_	_	95,77
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	122,30	_	_	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	_	_	_	140,69
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	-
Klasse A Aussch. GBP	_	_	_	_
Klasse A1 Thes.	_	_	_	100,92
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes.	140,52	117,57	96,28	104,32
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	102,62
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	167,07	107,12	122,31	96,62
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	126,91	108,95	108,76	97,67
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	131,62	112,57	-	80,23
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert) Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	_	- 143,51
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	_	_	- 128,91	143,31
Klasse C Aussch.	_	_	120,91	_
Klasse C Aussch. GBP	_	_	_	_
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	131,54	_	_	_
Klasse C1 Thes.	-	_	_	5.218,57
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	_	_	4.836,18
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	4.882,00
Klasse E Thes.	149,91	-	-	105,52
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	97,89
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	135,83	-	-	98,89
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	- 01.26
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	_	81,26
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	_	_	_	- 145,42
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	_	_	_	145,42
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.	178,21	134,70	98,74	108,36
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert) Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (ITI OSD abgesicriert)	-	-	_	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	_	_	_	_
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_	_
Klasse IF Aussch.	_	_	_	_
Klasse K Thes.	_	115,46	_	_
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	105,16	_	_
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	106,80	107,71	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	127,17	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	96,30	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	108,77	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)		-	128,94	-
Klasse X Thes.	93,01	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	134,99	-	-	

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

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil** zum 30. September 2019					
Klasse A Thes.	90,19	1.343,87	98,08	192,44	99,44
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	81,10	1.545,07	93,34	132,44	96,39
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	83,43	_	93,49	_	96,73
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	_	-	179,02	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	123,65	_	137,19	_	98,58
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_	185,96	_
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	189,83	-
Klasse A1 Thes.	-	-	98,54	182,12	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	180,78	-
Klasse C Thes.	91,67	1.343,89	99,97	204,59	99,96
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	82,83	-	95,24	-	97,25
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	84,25	-	95,20	100.53	97,58
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	88,21	-	78,01	188,52	98,52
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert) Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	_	_	- 782,57	26.296,37	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	_	_	139,16	_	99,45
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	_	_	155,10	196,82	- JJ, 4 J
Klasse C Aussch.	_	_	_	204,38	_
Klasse C Aussch. GBP	_	_	_	202,06	_
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	88,61	_	_		_
Klasse C1 Thes.	· –	_	100,82	_	4.896,70
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	95,35	_	4.862,29
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	95,34	-	4.879,79
Klasse E Thes.	94,51	-	100,74	203,46	100,27
Klasse E Thes. CHF	88,76	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	84,18	-	95,56	-	97,52
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	86,46	-	95,98	-	97,95
Klasse E Thes. GBP	102,29	-	77.70	-	- 00.01
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	91,87	-	77,78 785,09	-	98,81
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	_	_	139,72	_	99,61
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	91,25	_	139,72	_	99,01
Klasse F Thes.	-	1.344,00	_	_	_
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	_	1.094,39	_	_	_
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	_	1.143,68	_	_	_
Klasse F Aussch.	-	1.157,07	_	_	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1.555,75	-	_	-
Klasse I Thes.	100,54	1.476,61	105,40	276,20	99,36
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.291,72	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.354,51	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-		-	217,03	-
Klasse IF Thes.	-	1.376,55	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.203,99	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.262,49	-	-	-
Klasse IF Aussch. Klasse K Thes.	-	1.376,52	-	_	_
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	<u>-</u>	<u>-</u>	_	_	<u>-</u>
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	_	_	_		_
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	_	_	_		_
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	90,97	_	_	_	_
Klasse R Thes.	_	-	_	_	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	_	_	_	_
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)		_		_	97,60

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



March Section Sectio		Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Masse A Thes, (in CHF abgesichert)					
Masse A Thes. (in CHF abgesichert) 180,04 - - - 95,72 Masse A Thes. (in EUR abgesichert) - - - - - - - - -					101.00
Masse A Thes. (in EUR abgesichert)			-		
Klasse A Thes. (in GSD abgesichert) - - - 139,72 Klasse A Thes. (in USD abgesichert) -			_	_	
Masse A Thes. (in SGD abgesichert)		135,14	-	-	96,38
Masse A Thes. (in USD abgesichert)	` ' '	-	-	-	120.72
Masse A Hussch, GBP		-	-	-	139,72
Masses Al Thes. (in USD abgesichert)	, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,		_	_	_
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)			_	_	100 16
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)		_	_	_	100,10
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)		150 94	127 22	100 92	102 25
Masse C Thes. (in EUR abgesichert) 139,08 120,03 114,72 97,55 Masse C Thes. (in GPA abgesichert) 143,50 122,85					
Klasse C Thes. (in GPB abgesichert)					
Alasse C Thes. (in JPV abgesichert)	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)			· -	
Masse C Thes. (in ISGD abgesichert)		· -	_	_	_
Klasse C Thes. (in USD abgesichert) - - 133,02 - Klasse C Aussch. GBP - - - - Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) 143,44 - - - Klasse C Thes. - - - - 4.846,62 Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) - - - 4.846,62 Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) - - - - 182,77,98 Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) -	Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	_	_	_
Klasse C Aussch. Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) Klasse C Thes. Klasse C Thes. Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) Libration	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	141,47
Sease C Aussch. (in GBP abgesichert)	Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	133,02	-
Masse C Aussch. (in GBP abgesichert)		-	-	-	-
Stasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)		-	-	-	-
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert) - - - 4.846,62 Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert) 160,53 - - 4.877,98 Klasse E Thes. CHF - - - 0.2 102,99 Klasse E Thes. (in FUR abgesichert) - - - 97,61 Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 148,43 - - 98,30 Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - - - 142,59 Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - - - - 142,59 Klasse E Thes. (in GER abgesichert) -		143,44	-	-	
Klasse Ct Thes. (in EUR abgesichert) - - 4.877,98 Klasse E Thes. CHF - - - - Klasse E Thes. (In CHF abgesichert) - - - - - Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 148,43 - - 97,61 Klasse E Thes. (in BB abgesichert) 148,43 - - 80,38 Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) -		-	-	-	
Klasse E Thes. (In CHF abgesichert) 160,53 - - 102,99 Klasse E Thes. (In CHF abgesichert) - - - 97,61 Klasse E Thes. (In EUR abgesichert) 148,43 - - 98,30 Klasse E Thes. (In GBP abgesichert) - - 80,14 Klasse E Thes. (In GBP abgesichert) - - 80,14 Klasse E Thes. (In GBP abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (In GBP abgesichert) -<		-	-	-	
Riasse E Thes. (In CHF abgesichert)		160.53	-	-	
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 148,43 - - 97,61 Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 148,43 - - 98,30 Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - - - 142,59 Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) - - - - - Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) -			-	-	102,99
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 148,43 - - 98,30 Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) - - 80,14 Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) -		-	-	-	07.61
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)		1/18/13	_	_	
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) - - - 80,14 Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - </td <td>· • • • • • • • • • • • • • • • • • • •</td> <td>140,43</td> <td>_</td> <td>_</td> <td>96,50</td>	· • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	140,43	_	_	96,50
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert) - - - 142,59 Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) - - - 142,59 Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse F Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse F Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert) - - - - Klasse I Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) - - - - - Klasse I Thes. (in EUR abgesichert) -		_	_	_	80 14
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) – – – 142,59 Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert) – – – – Klasse F Thes. (in CHF abgesichert) – – – – Klasse F Thes. (in EUR abgesichert) – – – – – Klasse F Aussch. – – – – – Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert) – – – – – Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) –		_	_	_	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert) – – – – Klasse F Thes. – – – – Klasse F Thes. (in CHF abgesichert) – – – – Klasse F Thes. (in EUR abgesichert) – – – – Klasse F Aussch. – – – – – Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert) – – – – – Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) – <td< td=""><td></td><td>_</td><td>_</td><td>_</td><td>142,59</td></td<>		_	_	_	142,59
Klasse F Thes. - - - - Klasse F Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse F Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse F Aussch. - - - - - Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert) - <td></td> <td>_</td> <td>_</td> <td>_</td> <td>_</td>		_	_	_	_
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert) - - - - Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) 188,48 143,26 102,17 104,76 Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse I Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - 116,85 - - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) - - - - - Klasse R Thes. (in EUR a		_	_	_	_
Klasse F Aussch. -	Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	_	_	_
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert) - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - - </td <td>Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)</td> <td>-</td> <td>_</td> <td>-</td> <td>-</td>	Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	_	-	-
Klasse I Thes. 188,48 143,26 102,17 104,76 Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) – – – – Klasse I Thes. (in USD abgesichert) – – – – Klasse IF Thes. – – – – Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert) – – – – Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) – – – – Klasse IF Aussch. – – – – Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) – – – – Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) – 116,85 – – Klasse K Thes. (in USD abgesichert) – 118,25 114,20 – Klasse K Thes. (in USD abgesichert) – – – – Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) – – – – Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) – – – – Klasse R Thes. (in USD abgesichert) – – – – Klasse R Thes. (in USD abgesichert) – – – – </td <td></td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td>		-	-	-	-
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse I Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse I Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse IF Aussch. - - - - - Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - - - - - Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - 116,85 - - - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - - 131,91 - Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - - 100,92 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - - - - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - -		-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse I Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse IF Aussch. - - - - - Klasse IF Aussch. - <td< td=""><td></td><td>188,48</td><td>143,26</td><td>102,17</td><td>104,76</td></td<>		188,48	143,26	102,17	104,76
Klasse I Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse IF Aussch. - - - - Klasse IF Aussch. - - - - Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - 116,85 - - Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - - 131,91 - Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - -	Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse IF Thes. - - - - Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse IF Aussch. - - - - Klasse K Thes. - 125,56 - - Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - 116,85 - - Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse N Thes. (in USD abgesichert) - - 131,91 - Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - -		-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert) - - - - Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) - - - - Klasse IF Aussch. - - - - Klasse K Thes. - 125,56 - - Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - 116,85 - - Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse N Thes. (in USD abgesichert) - - 131,91 - Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) - - - 100,92 - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - 133,03 -		-	_	_	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert) -		-	-	-	-
Klasse IF Aussch. -		-	-	-	-
Klasse K Thes. - 125,56 - - Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - 116,85 - - Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - - - 131,91 - Klasse R Thes. (in GBP abgesichert) - - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - - 133,03 -	` <i>y</i>		_	_	_
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) - 116,85 - - Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - - 131,91 - Klasse N Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - 100,92 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - 133,03 -			125 56	_	_
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) - 118,25 114,20 - Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - - 131,91 - Klasse N Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - 133,03 -		_		_	_
Klasse K Thes. (in USD abgesichert) - - 131,91 - Klasse N Thes. (in GBP abgesichert) - - - - Klasse R Thes. - - 100,92 - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - 133,03 -		_		114 20	_
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert) - - - - - - - - - - - 100,92 - - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - 114,72 - - 133,03 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - 133,03 -		_	- 10,23		_
Klasse R Thes. - - 100,92 - Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - 133,03 -		_	_	-	_
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) - - 114,72 - Klasse R Thes. (in USD abgesichert) - - 133,03 -		-	_	100,92	_
Klasse R Thes. (in USD abgesichert) – – 133,03 –		-	_		_
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) – – – – – –		-	_		_
	Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)		_		

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

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA M&A* USD
ERTRÄGE						
Nettoausschüttungen [^]	-	_	_	4.366.120	23.153.030	153.979
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1.742.100	96.249.784	-	_	293.881	-
Nettoertrag aus Swaps	2.669.699	-	-	-	-	-
Bankzinsen	80	274	15.201	-	-	39
Sonstige Erträge	51.782	344.159	-	146.141	21.535	-
Erträge insgesamt	4.463.661	96.594.217	15.201	4.512.261	23.468.446	154.018
AUFWAND						
Performancegebühren	603.261	-	6.907.142	11.313.283	4.775.335	-
Managementgebühren	1.691.229	19.244.661	5.137.569	13.982.315	2.052.236	201
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	4.471.280	-	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	2.384.228	2.381.948	1.531.065	4.655
Verwahrstellengebühren	85.407	505.549	100.679	256.714	142.934	641
Verwaltungsgebühren	469.191	3.058.843	1.234.118	3.115.141	560.607	1.410
Taxe d'abonnement	80.549	76.806	205.859	467.871	146.949	189
Vertriebsgebühren	-	_	22.011	109.818	-	-
Abschreibung des Gründungsaufwands	3.770	-	-	-	-	-
Liquidationsaufwand	-	_	-	_	-	5.000
Bank- und Zinskosten	49.639	22.551	518	375.284	85.888	-
Sonstige Aufwendungen	90.092	755.009	207.879	2.803.299	215.046	377
Aufwendungen insgesamt	3.073.138	23.663.419	20.671.283	34.805.673	9.510.060	12.473
			· ·	•	·	
Abzüglich: Kostenzuschüsse	(96.398)	-	-	-	(30.883)	_
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	1.486.921	72.930.798	(20.656.082)	(30.293.412)	13.989.269	141.545



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

^ Einschließlich erhaltener/ausgezahlter Dividenden in Verbindung mit Derivaten, denen Aktien zugrunde liegen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
ERTRÄGE						
Nettoausschüttungen [^]	-	2.086.865	500	611.459	1.374.666	28.187.003
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	456.043	570.769	112.494	285.615	3.569.443	89.247.079
Nettoertrag aus Swaps	-	-	-	-	-	2.304.743
Bankzinsen	-	-	-	-	-	13.462
Sonstige Erträge	-	59.815	-	-	17.975	573.703
Erträge insgesamt	456.043	2.717.449	112.994	897.074	4.962.084	120.325.990
AUFWAND						
Performancegebühren	-	1.737.457	-	1.035.559	7.568.768	31.158.127
Managementgebühren	20.528	6.597.639	16.552.291	314.526	5.786.609	63.627.721
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	-	-	-	3.860.042
Nettoaufwand aus Swaps	-	3.426.917	10.771.954	319.558	4.041.573	21.884.659
Verwahrstellengebühren	5.250	112.296	300.827	11.770	282.669	1.596.646
Verwaltungsgebühren	11.432	1.352.233	3.554.521	103.287	1.454.534	13.333.175
Taxe d'abonnement	2.976	195.446	528.688	18.597	218.367	1.746.316
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	8	128.827
Abschreibung des Gründungsaufwands	-	-	-	-	-	3.255
Liquidationsaufwand	-	-	-	-	-	4.316
Bank- und Zinskosten	9.120	15.384	474.192	3.816	44.066	985.203
Sonstige Aufwendungen	3.215	201.203	615.131	21.158	244.574	4.841.572
Aufwendungen insgesamt	52.521	13.638.575	32.797.604	1.828.271	19.641.168	143.169.859
AL " P. L. IZ						(4.00.004)
Abzüglich: Kostenzuschüsse	402 502	- (40.004.406)	- (22.524.542)	(024 407)	- (4.4.670.004)	(109.881)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	403.522	(10.921.126)	(32.684.610)	(931.197)	(14.679.084)	(22.733.988)

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

^{**} Für die in Euro angegebene Summe der Ertrags- und Aufwandsrechnung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2021 umgerechnet: 1 Euro = 1,15835 US-Dollar und 1 Euro = 0,85969 Pfund Sterling.

[^] Einschließlich erhaltener/ausgezahlter Dividenden in Verbindung mit Derivaten, denen Aktien zugrunde liegen.

Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA M&A* USD
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***	1.486.921	72.930.798	(20.656.082)	(30.293.412)	13.989.269	141.545
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	11.114.653	(11.047.681)	82.597.574	207.454.760	39.799.815	47.573
aus Devisenterminkontrakten	72.803	(19.283.441)	(974.631)	(8.498.080)	(3.576.734)	13.606
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	2.382.866	-	(647)	(7.800.921)	(24.982.403)	(11.166)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	(13.096.949)	-	-	_	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	_	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	(2.258.972)	-	-	_	-	-
aus Total Return Swaps	_	-	-	(111.793.002)	(152.813.857)	-
aus Differenzkontrakten	_	-	(40.266.795)	_	139.736.286	(176.729)
aus Optionen und Swaptions	1.053.774	-	2.677.205	(411.172)	(5.564.650)	(8.910)
aus Devisen	240.206	(111.717)	(214.218)	(20.454.627)	1.778.417	(12.385)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	(491.619)	(30.442.839)	43.818.488	58.496.958	(5.623.126)	(148.011)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts)						
aus Anlagen	13.248.576	9.057.644	(14.628.238)	15.173.190	33.163.387	-
aus Devisenterminkontrakten	(1.642.938)	(18.774.512)	(3.082.044)	(6.974.078)	(7.566.062)	-
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	(1.642.279)	-	-	3.390.249	2.338.052	-
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	_	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	12.609.083	-	-	_	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	_	-	_
aus Zins-Swap-Kontrakten	(1.374.617)	_	_	_	_	_
aus Total Return Swaps	_	_	_	17.598.082	20.789.295	_
aus Differenzkontrakten	(372.928)	_	11.064.631	_	(17.532.685)	_
aus Optionen und Swaptions	4.470	_	(154.283)	231.486	554.788	_
aus Devisen	15.041	(524.382)	(6.086)	(32.147)	(201.791)	_
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTS)	20.844.408	(10.241.250)	(6.806.020)	29.386.782	31.544.984	-
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	21.839.710	32.246.709	16.356.386	57.590.328	39.911.127	(6.466)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	121.045.445	1.275.227.015	321.321.585	195.745.576	401.820.548	6.968.914
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(24.598.564)	(187.199.294)	(125.270.061)	(319.324.692)	(114.387.308)	(6.962.448)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	(134.177)	(677.713)			_	
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens	, ,					
während des Geschäftsjahres	118.152.414	1.119.596.717	212.407.910	(65.988.788)	327.344.367	-
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534	
Nennwährungsanpassung****	_	_	_	_	_	_
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901	-



^{*} Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.
*** Die Berechnung des Nettoanlageertrags/(-verlusts) finden Sie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung.
**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2020 und demselben

Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2021.

Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD		Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***	403.522	(10.921.126)	(32.684.610)	(931.197)	(14.679.084)	(22.733.988)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						_
aus verkauften Wertpapieren	19.177	142.412.291	1.007.099	90.966	73.301.173	500.435.507
aus Devisenterminkontrakten	1.301	(477.182)	12.902.895	(1.898.662)	16.381.351	(6.338.361)
aus Kassageschäften	-	-	669.271	-	-	577.780
aus Terminkontrakten	-	(287)	66.578.918	(559.911)	(2.161.644)	27.638.466
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	_	_	_	(981.438)	(847.272)
aus Credit Default Index-Kontrakten	_	_	350.935	_	(1.102.403)	(11.955.296)
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	_	_	_	_	(474.316)	(409.476)
aus Zins-Swap-Kontrakten	_	_	_	_	1.704.914	(478.317)
aus Total Return Swaps	_	(67.473.343)	(47.244.778)	_	(22.741.061)	(362.384.830)
aus Differenzkontrakten	_			1.680.774		87.674.225
aus Optionen und Swaptions	_	4.227	_	(250.554)	(7.815.929)	(9.037.131)
aus Devisen	19.719	2.194.510	(223.369)	2.706	4.760.699	(13.172.279)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	40.197	76.660.216	34.040.971	(934.681)	60.871.346	211.703.016
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts)						
aus Anlagen	(287.228)	(14.097.149)	(214.919)	8.077.212	7.430.348	53.637.952
aus Devisenterminkontrakten	139.162	(1.494.278)	(13.645.150)	465.904	(6.637.046)	(51.930.360)
aus Kassageschäften	-	-	15.896	-	-	13.723
aus Terminkontrakten	-	-	(13.224.263)	(6.110)	1.061.137	(6.516.589)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(508.473)	(438.963)
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	(215.884)	-	179.878	10.854.299
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	836.784	722.393
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1.900.608	454.086
aus Total Return Swaps	-	3.546.270	(5.943.202)	-	(3.350.576)	30.583.611
aus Differenzkontrakten	-	-	-	156.667	-	(5.723.563)
aus Optionen und Swaptions	-	421.626	-	(5.889)	(84.632)	865.175
aus Devisen	(1.184)	10.348	(410.831)	440	(356.608)	(1.305.424)
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTS)	(149.250)	(11.613.183)	(33.638.353)	8.688.224	471.420	31.216.340
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	294.469	54.125.907	(32.281.992)	6.822.346	46.663.682	220.185.368
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	28.332.442	85.423.397	225.846.496	1.797.424	109.590.621	2.421.323.644
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	-	(297.355.833)	(722.315.237)	(29.643.727)	(296.465.179)	(1.885.773.445)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	_	_	_	_	(700.902)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	28.626.911	(157.806.529)	(528.750.733)	(21.023.957)	(140.210.876)	755.034.665
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	_	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372	4.869.786.470
Nennwährungsanpassung****	_	_	_	_	_	49.538.577
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496	5.674.359.712

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

^{**} Für die in Euro angegebene Summe der Veränderung des Nettovermögens wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2021 umgerechnet: 1 Euro = 1,15835 US-Dollar und 1 Euro = 0,85969 Pfund Sterling.

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

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

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

Anleihen, Commercial Paper, ABS- um MBS-Title71,36verteating Commercial Paper, ABS- um Title of Title								
Modes Title (MSS-Title (MSS-TITL		BlueTrend	Cat Bond	Equity	Egerton Equity	Helix		
Soundige Wertpapiere								
Loth can be aumathart und Verteidigung -		71,30	94,32			17,04		
Agranvirtschaft -								
Fuggesellschaften -		_	-	-	_	-		
Bekladung - - - 1,16 0,48 Automabilhersteller 1,17	_	-	-	-	_	-		
Autoribolihersteller - - - - 1.17 Autoriboliher Jubehör - - - 0.00 1.00		-	-	_		0.49		
Autotelle und -zubehör -	_	-	_	-				
Banken - - - - 1,04 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.06 0.00		-	-	_				
Gerränke -<		-	-	-				
Biotechnologie - - - - 0.15 0.15 0.15 0.01 0.03 0.03 0.03 0.03 0.03 0.03 0.03 0.03 0.04 0.03 0.04 0.03 0.04 0.03 0.04 0		-	-	-				
Baustoffe - - - 0,49 0,49 1,54 1,59 Chemie - - - 5,44 1,59 Kohle - - - 7,43 2,08 0,47 Computer - - - 7,70 - 0,95 Kosmetki und Körperpflege - - - - 0,92 Vertrieb und Großhandel - - - - 0,92 Diversifizierte Finanzdienstleistungen - - - - 0,03 Elektrisk - - - - - 0,04 Elektronik -		-	-	-				
Chemie - <td>_</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> <td></td>	_	-	-	-				
Köhle - <td></td> <td>-</td> <td>-</td> <td>_</td> <td></td> <td></td>		-	-	_				
Gewerbliche Dienstleistungen - - 7,43 2,08 0,95 Kosmetik und Körperpflege - - - - 0,95 Kosmetik und Körperpflege - - - - 0,92 Vertrieb und Großhandel - - - 0,92 Diversifizierte Finanzdienstleistungen - - - 0,01 Elektrisk - - - - 0,01 Elektrische Bautelle und Geräte - - - - 0,01 Elektrische Bautelle und Geräte - - - - 0,01 Elektrische Bautelle und Geräte - - - - 0,01 Beiterbrisch - - - - - - Ilektrische Bautelle und Geräte -		-	-					
Computer - - 7,70 - 0,95 Kosmetik und Körperpflege -		-	-					
Kosmetik und Körperpflege - - - - 0,25 Vertrieb und Großhandel - - - - 0,92 Diversifizierte Finanzdienstleistungen - - - - - - - 0,92 Elektrisk - - - - - - - 0,01 Elektrische Bauteile und Geräte -		-	-					
Vertrieb und Großhandel -	·	-	-	7,70	-			
Diversifizierte Finanzdienstleistungen - - - 11,52 3,37 Elektrik - - - 0,01 0,01 Elektrische Bauteille und Geräte - - - 0,01 Elektronik - - - 0,06 Elektronik - - - 0,06 Energie - Alternative Energiequellen - - - 0,06 Bau- und Ingenieurswesen - - - - 0,06 Unterhaltung -		-	-	-	-			
Elektrik - - - - - 0,01 Elektroik -		-	-	-				
Elektrische Bauteile und Geräte - - - - 0,84 Elektronik - - - - 2,06 Energie - Alternative Energiequellen - - - - 0,61 Bau- und Ingenieurswesen - <t< td=""><td></td><td>-</td><td>-</td><td>-</td><td>11,52</td><td></td></t<>		-	-	-	11,52			
Elektronik - - - - 2.06 Energie - Alternative Energiequellen - - - - 0.61 Bau- und Ingenieurswesen - - - - - - Unterhaltung -		-	-	-	-			
Energie - Alternative Energiequellen - - - 0.61 Bau- und Ingenieurswesen - <td></td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td>		-	-	-	-			
Bau- und Ingenieurswesen - <td></td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td>		-	-	-	-			
Unterhaltung - <t< td=""><td></td><td>-</td><td>-</td><td>-</td><td>-</td><td>0,61</td></t<>		-	-	-	-	0,61		
Umweltschutz - - - - 0.12 Lebensmittel - - - - 2,02 Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier -		-	-	-	-	-		
Lebensmittel - - - - 2,02 Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier -	_	-	-	-	-	-		
Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier - <td></td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td>		-	-	-	-			
Gas - - - - 0,01 Gesundheitswesen - Produkte - - - 0,44 Gesundheitswesen - Dienstleistungen - - - 3,62 0,88 Holdinggesellschaften - Diversifiziert - - - - 3,62 0,88 Wohngebäude-Bauträger - - - 3,26 0,06 Heimeinrichtungsgegenstände - - - - 1,31 Haushaltswaren - - - - 0,42 Versicherungen - - - - 0,42 Versicherungen - - - - 0,42 Internet - - - - 0,49 Internet - - - 1,77 4,52 Eisen und Stahl - - - - 0,64 Freizeit - - - - - 0,35 Masch		-	-	-	-	2,02		
Gesundheitswesen – Produkte - - - 0,44 Gesundheitswesen – Dienstleistungen - - - 3,62 0,88 Holdinggesellschaften – Diversifiziert - <t< td=""><td>Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier</td><td>-</td><td>-</td><td>-</td><td>-</td><td>-</td></t<>	Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier	-	-	-	-	-		
Gesundheitswesen – Dienstleistungen - - - 3,62 0,88 Holdinggesellschaften – Diversifiziert -		-	-	-	-	0,01		
Holdinggesellschaften – Diversifiziert -		-	-	-	-			
Wohngebäude-Bauträger - - - 3,26 0,06 Heimeinrichtungsgegenstände - - - 1,31 Haushaltswaren - - - - 0,42 Versicherungen - 2,36 - - 0,42 Internet - 2,36 - 19,97 1,97 Investmentgesellschaften - - - 1,77 4,52 Eisen und Stahl - - - - 0,64 Freizeit - - - - 0,64 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - 0,33 Maschinen - Diversifiziert - - - - - 0,52 Medien -	3	-	-	-	3,62	0,80		
Heimeinrichtungsgegenstände - - - - 1,31 Haushaltswaren - - - - 0,42 Versicherungen - 2,36 - - 0,49 Internet - 2,36 - - 0,49 Internet - - 18,37 19,97 1,97 Investmentgesellschaften - - - 1,77 4,52 Eisen und Stahl - - - - 0,64 Freizeit - - - - 0,34 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - - 0,52 Medien - <		-	-	-	-	-		
Haushaltswaren - - - - 0,42 Versicherungen - 2,36 - - 0,49 Internet - - 18,37 19,97 1,97 Investmentgesellschaften - - - 1,77 4,52 Eisen und Stahl - - - - 0,64 Freizeit - - - - 0,34 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - 0,52 Medien - - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren -		-	-	-	3,26	0,06		
Versicherungen - 2,36 - - 0,49 Internet - - 18,37 19,97 1,97 Investmentgesellschaften - - - 1,77 4,52 Eisen und Stahl - - - - 0,64 Freizeit - - - - 0,34 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - 0,52 Medien - - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren -		-	-	-	-	1,31		
Internet - - 18,37 19,97 1,97 Investmentgesellschaften - - - 1,77 4,52 Eisen und Stahl - - - - 0,64 Freizeit - - - - 0,34 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - 0,52 Medien - - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren - - - - - - - - 1,11		-	-	-	-	0,42		
Investmentgesellschaften - - - 1,77 4,52 Eisen und Stahl - - - - 0,64 Freizeit - - - - 0,34 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - 0,52 Medien - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren - - - - - - 1,11	Versicherungen	-	2,36	-	-	0,49		
Eisen und Stahl - - - - - 0,64 Freizeit - - - - - 0,34 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - - 0,52 Medien - - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren - <td< td=""><td></td><td>-</td><td>-</td><td>18,37</td><td>19,97</td><td>1,97</td></td<>		-	-	18,37	19,97	1,97		
Freizeit - - - - - 0,34 Maschinen - Bau und Bergbau - - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - - 0,52 Medien - - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren - - - - - - - - 1,11		-	-	-	1,77	4,52		
Maschinen - Bau und Bergbau - - - - - 0,35 Maschinen - Diversifiziert - - - - - 0,52 Medien - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren - - - - - - - - 1,111 Bergbau - - - - - - 1,21 - 1,111	Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,64		
Maschinen - Diversifiziert - - - - 0,52 Medien - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren - - - - - - - - 1,111 Bergbau - - - - - - 1,21 - 1,111		-	-	-	-	0,34		
Medien - - 9,68 10,90 - Metallprodukte und Eisenwaren - - - - - - - - - - - 1,111 Bergbau - - - - - - 1,111	Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,35		
Metallprodukte und Eisenwaren – – – – – – – – – – – – – – – – – – –	Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	0,52		
Bergbau – – – 1,11	Medien	-	-	9,68	10,90	-		
	Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	-		
Diverse Fertigungsbetriebe – – – – 0,35	Bergbau	-	-	-	-	1,11		
	Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	0,35		

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Büro- und Geschäftsausstattung	-	-	1,05	-	-
Öl und Gas	-	-	-	-	7,13
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	-
Verpackung und Container	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	0,42	1,52
Pipelines	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	8,53	0,48	0,17
Einzelhandel	-	-	-	5,18	4,04
Bausparkassen	-	-	-	-	-
Halbleiter	-	-	9,99	5,35	15,68
Software	-	-	27,53	5,00	1,38
Lagerung	-	-	-	-	-
Telekommunikation	-	-	-	0,73	0,67
Spielwaren, Spiele und Hobbys	-	-	-	-	-
Transport	-	-	-	16,94	0,07
Wasser	-	-	-	-	-
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	71,36	96,88	90,28	96,21	89,26
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	28,64	3,12	9,72	3,79	10,74
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

Anleihen, Commercial Paper, ABS- und		Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
MBS-Titel	98,29	0,78	26,44	58,88	38,39
Sonstige Wertpapiere	<u> </u>	-		<u> </u>	
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	_	0,98	_	_	0,05
Agrarwirtschaft	-	0,27	_	_	_
Fluggesellschaften	-	2,68	_	_	_
Bekleidung	-	0,98	_	_	-
Automobilhersteller	-	1,50	_	_	0,41
Autoteile und -zubehör	-	1,78	_	_	0,04
Banken	_	5,22	_	_	6,45
Getränke	_	3,97	_	1,48	0,08
Biotechnologie	_	-	_	_	2,87
Baustoffe	_	3,18	_	_	0,49
Chemie	_	1,23	_	_	0,32
Kohle	-	_	_	_	0,09
Gewerbliche Dienstleistungen	_	6,82	_	4,11	1,95
Computer	_	0,90	_	0,58	0,26
Kosmetik und Körperpflege	-	_	_	_	_
Vertrieb und Großhandel	-	_	_	_	0,18
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	6,92	_	1,17	1,42
Elektrik	-	_	_	_	1,86
Elektrische Bauteile und Geräte	-	_	_	_	0,34
Elektronik	-	0,60	_	1,63	0,16
Energie – Alternative Energiequellen	_	_	_	_	0,46
Bau- und Ingenieurswesen	_	4,47	_	_	0,50
Unterhaltung	_	_	_	1,86	0,02
Umweltschutz	_	0,82	_	_	0,06
Lebensmittel	_	0,15	_	_	_
Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier	_	_	_	_	0,07
Gas	-	_	_	_	0,22
Gesundheitswesen – Produkte	-	8,72	_	1,57	1,48
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	_	_	-	0,41
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	_	_	_	0,48
Wohngebäude-Bauträger	_	1,39	_	_	0,43
Heimeinrichtungsgegenstände	_	_	_	_	0,11
Haushaltswaren	_	_	_	2,14	_
Versicherungen	_	_	_	_	2,93
Internet	_	4,18	_	_	0,52
Investmentgesellschaften	_	_	0,55	2,99	0,57
Eisen und Stahl	-	_		_,	0,32
Freizeit	-	3,53	_	1,23	0,11
Maschinen – Bau und Bergbau	_	-	_		0,15
Maschinen – Diversifiziert	_	_	_	1,06	0,51
Medien	_	1,22	_	-,30	-
Metallprodukte und Eisenwaren	_		_	_	0,19
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,13

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



Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

		Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	3,05	0,42
Büro- und Geschäftsausstattung	-	-	-	-	-
Öl und Gas	-	0,15	-	-	6,45
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	2,38	-	-	0,09
Verpackung und Container	-	1,10	-	-	-
Pharmazeutika	-	2,52	-	-	1,21
Pipelines	-	-	-	-	0,68
Immobilien	-	0,38	-	1,27	0,36
Einzelhandel	-	7,77	_	3,32	0,16
Bausparkassen	-	-	-	-	0,04
Halbleiter	-	3,14	-	-	0,35
Software	-	7,53	-	1,40	0,37
Lagerung	-	-	-	1,97	-
Telekommunikation	-	2,75	_	-	0,06
Spielwaren, Spiele und Hobbys	-	0,32	_	-	_
Transport	-	1,08	_	-	0,37
Wasser	-	-	_	-	0,09
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	98,29	91,41	26,99	89,71	76,25
Termineinlagen	-	_	17,79	-	-
Sonstiges Nettovermögen	1,71	8,59	55,22	10,29	23,75
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

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

Anlageportfolio zum 30. September 2021

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Üb un die Bö zug
Anleihen					Aktien		
Vereinigte	Staaten		130.183.339	63,17	Supranatio	nal	
6.800.000	USD	United States Treasury	6.807.338	3,30	550	USD	Vo
7.000.000	USD	Note 15/10/21, 2.88% United States Treasury	0.607.556	3,30	Summe Ak	tien	
		Note 30/11/21, 1.75%	7.019.468	3,41	Anleihen		
4.000.000	USD	United States Treasury Note 15/12/21, 2.63%	4.021.159	1,95	Bermuda		
7.000.000	USD	United States Treasury Note 15/01/22, 2.50%	7.049.530	3,42	14.963.000	USD	320 var
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/02/22, 2.00%	6.043.472	2,93	39.750.000 USD		Ace vai
7.000.000	USD	United States Treasury Note 15/03/22, 2.38%	7.074.536	3,43	7.500.000	USD	Ala vai
3.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/22, 1.75%	3.545.803	1,72	10.263.000	USD	Ba vai
8.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/22, 1.38%	8.105.419	3,93	24.400.000	USD	Bo 23/
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/22, 1.63%	9.152.930	4,44	4.750.000	USD	Bo 20
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/12/22, 1.63%	9.162.949	4,45	14.350.000	USD	Boy 20/
6.700.000	USD	United States Treasury Note 15/01/23, 1.50%	6.817.904	3,31	44.750.000	USD	Ca 25
4.300.000	USD	United States Treasury Note 15/02/23, 1.38%	4.371.891	2,12	20.170	USD	Ed:
9.500.000	USD	United States Treasury Note 15/03/23, 0.50%	9.545.831	4,63	6.006	USD	Ed:
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/04/23, 0.25%	10.008.399	4,87	19.873	USD	Ede
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/05/23, 0.13%	9.986.915	4,85	13.309	USD	Ed
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/06/23, 0.25%	6.002.461	2,91	1.800.000	USD	22 Ed
9.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/23, 0.13%	9.481.631	4,60	7.200.000	USD	Ed 21
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/08/23, 0.13%	5.985.703	2,90	16.200.000	USD	Ed 21.
Summe An			130.183.339	63,17	19.250.000	USD	Eve
Geldmarkt	instrumen	Wertpapiere und te, die zu einer amtlichen elassen sind	130.183.339	63,17	11.262.000		14. Eve
Dorseimon	cruing zug	Cid35Cii 3iiid	150.105.555	03,17			A1
Anzahl der Anteile			Markt-	% des Netto-	17.750.000	USD	Eve A2
oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	wert USD	vermö- gens	17.500.000	USD	Flo 07
Anleihen					3.000.000	USD	Flo
Irland			16.885.189	8,19	C F00 000	LICD	07
283.308.544	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	16.885.189	8,19	6.500.000	USD	Flo 27
Summe An	leihen		16.885.189	8,19	9.750.000	USD	Flo 27
Summe sonstige Wertpapiere			16.885.189	8,19	4.700.000	USD	Ga
Summe Ka			147.068.528	71,36	2 750 000	LICD	08 <i>i</i>
Sonstiges Nettovermögen Nettoinventarwert			59.021.812	28,64	3.750.000	USD	Ga 08/
ivertoinven	ıtai wert		206.090.340	100,00			

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen	Markt-	% des Netto-
oder Nenn- betrag	Währung	Börsennotierung zugelassen sind	wert USD	vermö- gens
Aktien		5		J
Supranatio	nal		55.709.500	2,36
550	USD	Voussoir Re SideCar	55.709.500	2,36
Summe Ak	tien		55.709.500	2,36
Anleihen				
Bermuda			852.207.225	36,05
14.963.000	USD	3264 Re 07/02/23, variabel	15.357.275	0,65
39.750.000	USD	Acorn Re 10/11/21, variabel	39.887.137	1,69
7.500.000	USD	Alamo Re 08/06/22, variabel	7.631.625	0,32
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	10.375.893	0,44
24.400.000	USD	Bowline Re Series 2018-1 23/05/22, variabel	24.891.659	1,05
4.750.000	USD	Bowline Re Series 2019-1A 20/03/23, variabel	4.866.613	0,21
14.350.000	USD	Bowline Re Series 2019-1B 20/03/23, variabel	14.702.293	0,62
44.750.000	USD	Cape Lookout Re 25/02/22, variabel	45.280.287	1,92
20.170	USD	Eden Re II Series A 22/03/22, ZCP	100.353	_
6.006	USD	Eden Re II Series B 22/03/22, ZCP	81.734	_
19.873	USD	Eden Re II Series A 22/03/23, ZCP	247.097	0,01
13.309	USD	Eden Re II Series B 22/03/23, ZCP	415.751	0,02
1.800.000	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP	1.661.040	0,07
7.200.000	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	7.270.560	0,31
16.200.000	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	16.332.840	0,69
19.250.000	USD	Everglades Re Series B1 14/05/24, variabel	19.636.925	0,83
11.262.000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel	11.463.590	0,49
17.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel	18.071.275	0,76
17.500.000	USD	FloodSmart Re Series A 07/03/22, variabel	17.193.750	0,73
3.000.000	USD	FloodSmart Re Series B 07/03/22, variabel	2.940.000	0,12
6.500.000	USD	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variabel	6.402.500	0,27
9.750.000	USD	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variabel	9.530.625	0,40
4.700.000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	4.761.570	0,20
3.750.000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	3.799.125	0,16

Anlageportfolio zum 30. September 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD		Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
2.400.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	2.557.200	0,11	44.420.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	44.582.132	1,89
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/23, variabel	5.123.750	0,22	19.000.000	USD	Northshore Re II 08/07/22, variabel	19.392.350	0,82
7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/23, variabel	8.071.044	0,34	14.180.000	USD	Northshore Re II 07/07/23, variabel	14.745.073	0,62
4.750.000	USD	Kilimanjaro II Re 21/04/22, variabel	4.695.613	0,20	12.962.000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel	13.501.219	0,57
2.850.000	USD	Kilimanjaro II Re Series * 21/04/22, variabel	2.871.518	0,12	8.884.000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel	9.067.010	0,38
15.450.000	USD	Kilimanjaro II Re Series ** 21/04/22, variabel	15.710.333	0,66	23.029.000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	23.503.397	0,99
10.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/23, variabel	9.880.488	0,42	5.000.000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel	5.010.000	0,21
10.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	10.626.688	0,45	23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	23.305.900	0,99
5.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	4.973.588	0,21	5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5.858.675	0,25
9.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	9.466.382	0,40	21.500.000	USD	Sanders Re 06/12/21, variabel	21.610.725	0,91
3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	3.829.875	0,16	2.800.000	USD	Sanders Re 07/04/22, variabel	2.250.500	0,10
4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4.904.850	0,21	15.250.000	USD	Sanders Re II 07/04/23, variabel	495.625	0,02
8.214.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A2 20/04/26, variabel	8.431.671	0,36	5.270.000	USD	Sanders Re II 07/06/23, variabel	5.429.945	0,23
4.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	4.096.000	0,17	9.625.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel	9.889.928	0,42
3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	3.840.750	0,16	16.447.000	USD	Sanders Re II 07/04/25, variabel	16.634.496	0,70
4.950.000	USD	Kilimanjaro Re Series A1 06/05/22, variabel	4.895.798	0,21	6.500.000	USD	Sutter Re Series A 06/06/22, variabel	6.641.375	0,28
18.600.000	USD	Kilimanjaro Re Series B1 06/05/22, variabel	19.002.690	0,80	11.250.000	USD	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	11.702.813	0,50
6.000.000	USD	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel	5.835.300	0,25	7.000.000	USD	Sutter Re Series F 06/06/22, variabel	7.173.250	0,30
17.600.000	USD	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variabel	18.032.080	0,76	10.800.000	USD	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	11.272.500	0,48
1.750.000	USD	Manatee Re III Series A 07/06/22, variabel	1.575.000	0,07	14.800.000	USD	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	14.896.940	0,63
1.750.000	USD	Manatee Re III Series B 07/06/22, variabel	243.250	0,01	14.900.000	USD	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	15.040.805	0,64
18.312.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/22, variabel	18.361.442	0,78	9.550.000	USD	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	9.663.168	0,41
25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel	26.343.177	1,11	9.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	9.689.525	0,41
7.000.000	USD	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variabel	7.160.650	0,30	6.920.000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variabel	7.123.448	0,30
9.714.000	USD	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variabel	9.920.423	0,42	1.460.000	USD	Voussoir Re perpetual, variabel	139.795	0,01
30.000.000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel	30.913.499	1,31	3.500.000	USD	Wrigley Re 08/07/24, variabel	3.522.225	0,15
15.690.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	15.799.830	0,67	Hongkong			2.908.800	0,12
		17/01/25, valiabel	13.733.030	0,07	3.000.000	USD	Greater Bay Re 15/10/22, ZCP	2.908.800	0,12

Anlageportfolio zum 30. September 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	, Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Irland			9.168.247	0,39
7.856.000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	9.168.247	0,39
Singapur			39.135.145	1,66
17.250.000	USD	Alamo Re II 08/06/23, variabel	18.196.163	0,77
9.783.000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	9.940.995	0,42
6.750.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6.772.950	0,29
4.012.000	USD	Phoenix 1 Re 04/01/27, ZCP	4.225.037	0,18
Supranatio	nal		58.513.656	2,48
3.450.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variabel	3.500.025	0,15
14.800.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variabel	15.070.840	0,64
18.500.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	18.703.499	0,79
3.697.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	3.751.346	0,16
5.550.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5.619.375	0,24
6.700.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6.925.958	0,29
4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4.942.613	0,21
Vereinigtes Königreich			18.099.050	0,77
17.000.000	USD	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	18.099.050	0,77
Summe An	leihen	980.032.123	41,47	
Summe übe Geldmarkti Börsennoti	instrumen	1.035.741.623	43,83	

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen		,		
Bermuda			710.078.829	30,05
7.308.000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	7.589.723	0,32
21.900.000	USD	Akibare Re Series A 07/04/22, variabel	22.057.680	0,93
8.000.000	USD	Akibare Re Series B 07/04/22, variabel	8.076.800	0,34
3.673.921	USD	Akibare Re 07/04/23, variabel	12.491	_
39.726.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	40.826.410	1,72
9.250.000	USD	Armor Re II 08/06/22, variabel	9.446.563	0,40
19.855.000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	20.326.556	0,86
16.996.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	17.350.367	0,73
7.500.000	USD	Cape Lookout Re 09/05/22, variabel	7.675.875	0,32
24.917.000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	25.113.844	1,06
816.477	USD	Citrus Re 20/03/23, variabel	490.662	0,02
11.000.000	USD	Everglades Re II 04/05/23, variabel	11.403.150	0,48
31.404.000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	29.990.820	1,27
5.625.000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	5.343.750	0,23
12.850.000	USD	Frontline Re Series A 06/07/22, variabel	11.243.750	0,48
1.499.378	USD	Frontline Re Series B 06/07/22, variabel	74.969	_
2.500.000	USD	Herbie Re 06/01/23, variabel	2.328.125	0,10
7.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	6.300.000	0,27
3.833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	4.080.420	0,17
5.114.000	USD	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	5.409.589	0,23
379.000	USD	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	404.355	0,02
4.950.000	USD	Integrity Re 10/06/22, variabel	5.049.248	0,21
6.000.000	USD	Isosceles Insurance 10/07/23, variabel	5.850.000	0,25
7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	8.058.139	0,34
6.500.000	USD	Matterhorn Re 07/12/21, variabel	6.582.875	0.28

07/12/21, variabel

6.582.875

0,28



Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
12.000.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variabel	12.117.000	0,51	3.500.000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3.549.700	0,15
3.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variabel	3.549.525	0,15	20.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	20.072.000	0,85
16.000.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/21, variabel	16.021.600	0,68	19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	19.511.800	0,83
17.000.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/21, ZCP	16.745.850	0,71	22.982.000	USD	Ursa Re 10/12/22, variabel	23.615.154	1,00
7.250.000	USD	Matterhorn Re Series B* 07/12/21, variabel	7.268.125	0,31	41.725.000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	43.335.585	1,82
13.118.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/22, variabel	13.383.640	0,57	9.500.000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	9.812.550	0,42
14.250.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/22, variabel	14.458.763	0,61	21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	21.846.735	0,92
7.500.000	USD	Matterhorn Re	7 422 000	0.24	Kaimanins	eln		177.845.511	7,53
15.500.000	USD	08/01/24, variabel Merna Reinsurance II	7.422.000	0,31	1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	550.347	0,02
22.340.000	USD	07/04/23, variabel Merna Reinsurance II	15.717.000	0,67	6.600.000	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	957.000	0,04
6.000.000	USD	05/04/24, variabel MetroCat Re	22.688.504	0,96	132.536	USD	Caelus Re V Series D 05/06/24, variabel	1.352	_
20.000.000	USD	08/05/23, variabel Mona Lisa Re	6.154.200	0,26	6.350.000	USD	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	6.598.920	0,28
5.333.000	USD	08/07/25, variabel Mystic Re IV Series A	20.454.000	0,87	13.050.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	13.686.839	0,58
4.286.000	USD	08/01/25, variabel Mystic Re IV Series B	5.399.929	0,23	26.000.000	USD	Long Point Re III 01/06/22, variabel	26.321.099	1,12
15.750.000	USD	08/01/25, variabel Nakama Re	3.480.232	0,15	10.050.000	USD	Residential Reinsurance 2017 06/12/21, variabel	10.022.363	0,42
12.052.000	USD	13/10/21, variabel	15.809.063	0,67	15.400.000	USD	Residential Reinsurance		
12.952.000		Nakama Re 13/10/26, variabel	12.999.275	0,55			2018 Series 13 06/06/22, variabel	15.550.149	0,67
8.500.000	USD	Nakama Re 144A 13/10/21, variabel	8.531.875	0,36	11.975.000	USD	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variabel	11.869.021	0,50
21.325.000	USD	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	21.394.306	0,91	4.000.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 12	4.056.000	0.47
12.200.000	USD	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	12.254.290	0,52	2.250.000	USD	06/06/23, variabel Residential Reinsurance	4.056.000	0,17
7.500.000	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	5.250.000	0,22			2019 Series 13 06/06/23, variabel	2.253.938	0,10
4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	4.714.375	0,20	7.062.000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	7.012.919	0,30
2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2.250.000	0,10	6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6.258.310	0,26
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	20.303.222	0,86	5.484.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3		
17.292.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	17.639.569	0,75	5.000.000	USD	06/12/24, variabel Residential Reinsurance	5.542.405	0,23
3.750.000	USD	Sierra Series A 28/12/22, variabel	3.800.063	0,16			2020 Series 4 06/12/24, variabel	5.150.250	0,22
2.750.000	USD	Sierra Series B 28/12/22, variabel	2.807.888	0,12	4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	4.321.400	0,18
14.500.000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14.634.850	0,62	5.535.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12	4.321.400	0,10
							06/06/25, variabel	5.621.900	0,24

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4.712.558	0,20
6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6.583.850	0,28
1.050.000	USD	Vitality Re IX Series A 10/01/22, variabel	1.046.063	0,04
1.900.000	USD	Vitality Re IX Series B 10/01/22, variabel	1.886.605	0,08
5.250.000	USD	Vitality Re X Series A 10/01/23, variabel	5.177.813	0,22
2.250.000	USD	Vitality Re X Series B 10/01/23, variabel	2.199.263	0,09
9.117.000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	8.984.348	0,38
3.500.000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3.432.275	0,15
12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	12.050.624	0,51
6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5.997.900	0,25
Irland			66.048.767	2,80
10.000.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	10.653.500	0,45
10.966.000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	12.765.978	0,54
4.350.000	EUR	Hexagon Reinsurance DAC Series A 19/01/22, variabel	5.048.900	0,21
4.000.000	EUR	Hexagon Reinsurance DAC Series B 19/01/22, variabel	4.641.508	0,20
20.000.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	23.216.809	0,99
8.269.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	9.722.072	0,41
Singapur			30.977.837	1,31
4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	4.081.400	0,17
6.000.000	USD	Catahoula Re 09/05/23, variabel	322.500	0,01
6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	6.592.860	0,28
9.966.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	10.234.583	0,44
5.000.000	USD	Umigame Re Series A-1 07/04/25, variabel	5.057.250	0,21
2.750.000	USD	Umigame Re Series A-2 07/04/25, variabel	2.783.963	0,12
1.875.000	USD	Umigame Re Series B-1 07/04/25, variabel	1.905.281	0,08

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	, Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigtes	Königreicl	h	43.107.454	1,82
27.275.000	USD	Atlas Capital UK 2018 07/06/22, variabel	27.538.204	1,16
15.000.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	15.569.250	0,66
Vereinigte S	Staaten		204.644.213	8,66
7.920.000	USD	Chesterfield Financial Holdings 15/12/34, 4.50%	8.098.200	0,34
8.307.000	USD	Putnam Re 07/06/24, variabel	8.499.722	0,36
75.000.000	USD	United States Treasury Bill 14/10/21, ZCP	74.999.526	3,17
100.000.000	USD	United States Treasury Bill 18/11/21, ZCP	99.996.667	4,24
12.803.000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	13.050.098	0,55
Summe Anl	eihen		1.232.702.611	52,17
		Wertpapiere und		
		e, die an einem anderen andelt werden	1.232.702.611	52,17

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte:	Staaten		20.784.238	0,88
14.753.326	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5.96%	16.007.358	0,68
2.400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	_
4.342.618	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	4.776.880	0,20
Summe An	leihen		20.784.238	0,88
Summe sor	nstige Wer	20.784.238	0,88	
Summe Kap	pitalanlage	2.289.228.472	96,88	
Sonstiges N	lettoverm	73.811.053	3,12	
Nettoinven	tarwert		2.363.039.525	100,00



Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Israel			4.836.398	1,09
162.568	USD	WalkMe	4.836.398	1,09
Vereinigte	Staaten		393.932.686	89,19
116.986	USD	Activision Blizzard	9.053.547	2,05
1.098.367	USD	Avaya Holdings	21.736.683	4,92
52.809	USD	Blackline	6.234.631	1,41
736.000	USD	Cargurus	23.117.760	5,23
204.814	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	2.152.595	0,49
190.495	USD	Ceridian HCM Holding	21.453.547	4,86
121.783	USD	Cirrus Logic	10.028.830	2,27
380.369	USD	Cornerstone OnDemand	21.779.929	4,93
382.368	USD	Coursera	12.101.947	2,74
3.322	USD	Freshworks	141.816	0,03
296.177	USD	Green Dot	14.906.588	3,37
340.240	USD	Marvell Technology	20.519.874	4,65
140.295	USD	nCino	9.965.154	2,26
545.500	USD	NCR	21.143.580	4,79
291.405	USD	New Relic	20.914.137	4,73
1.816.250	USD	News	42.736.362	9,68
704.018	USD	Outfront Media	17.741.254	4,02
81.123	USD	Qorvo	13.562.954	3,07
398.288	USD	Redfin	19.954.229	4,52
116.196	USD	Toast	5.803.990	1,31
131.048	USD	TripAdvisor	4.435.975	1,00
334.103	USD	Twitter	20.176.480	4,57
229.796	USD	Xerox Holdings	4.634.985	1,05
55.421	USD	Zendesk	6.450.450	1,46
306.133	USD	Zillow Group	26.982.563	6,11
12.761	USD	Zoom Video Communications	3.337.002	0,76
49.065	USD	Zscaler	12.865.824	2,91
Summe Ak	tien		398.769.084	90,28
Geldmarkt	instrumen	Wertpapiere und te, die zu einer amtlichen	200 750 004	00.00
Summe Ka		elassen sind	398.769.084	90,28
Sonstiges N		398.769.084	90,28	
Nettoinver		0 90	42.934.276	9,72
Merrollivel	icai wei t		441.703.360	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag Aktien	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% des Netto- vermö- gens
Kanada			136.652.049	14,39
389.334	CAD	Canadian National Railway	38.950.220	4,10
1.403.109	CAD	Canadian Pacific Railway	79.098.844	8,33
15.894	USD	Shopify	18.602.985	1,96
Indien			9.261.939	0,98
290.111	INR	Housing Development Finance	9.261.939	0,98
Russland			7.402.189	0,78
107.596	USD	Yandex	7.402.189	0,78
Taiwan			36.815.513	3,88
31.644	USD	Sea	8.707.120	0,92
1.564.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	28.108.393	2,96
Vereinigtes	Königreic	h	46.853.420	4,93
184.991	USD	Linde	46.853.420	4,93
Vereinigte	Staaten		676.457.833	71,25
35.867	USD	Alphabet	82.528.314	8,70
6.632	USD	Amazon.com	18.808.120	1,98
157.067	USD	Analog Devices	22.709.527	2,39
658.684	USD	Bath & Body Works	35.841.371	3,77
174.431	USD	Blackstone Mortgage Trust	4.565.760	0,48
705.101	USD	Charles Schwab	44.338.548	4,67
103.147	USD	Charter Communications	64.786.663	6,83
185.130	USD	CIT Group	8.302.761	0,87
801.141	USD	Comcast	38.682.450	4,07
1.667.426	USD	CSX	42.810.247	4,51
426.887	USD	DR Horton	30.945.484	3,26
122.926	USD	Facebook	36.016.623	3,79
13.398	USD	First Citizens BancShares	9.752.486	1,03
109.974	USD	Herbalife Nutrition	4.023.566	0,42
41.893	USD	International Flavors & Fragrances	4.836.131	0,51
319.804	USD	KKR	16.808.104	1,77
34.398	USD	Mastercard	10.324.597	1,09
194.852	USD	Microsoft	47.423.210	5,00
33.216	USD	Netflix	17.501.665	1,84
66.915	USD	PayPal Holdings	15.031.685	1,58
124.171	USD	PVH	11.018.722	1,16
8.093	USD	RH	4.659.475	0,49
22.730	USD	Square	4.706.318	0,50
62.673	USD	T-Mobile US	6.912.507	0,73

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% des Netto- vermö- gens
101.954	USD	UnitedHealth Group	34.391.597	3,62
181.907	USD	Victoria's Secret	8.678.017	0,91
236.082	USD	Visa	45.398.425	4,79
31.879	USD	Vulcan Materials	4.655.460	0,49
Summe Akt	tien		913.442.943	96,21
Geldmarkti	instrumen	Wertpapiere und te, die zu einer amtlichen elassen sind	913.442.943	96,21
Summe Kaj	pitalanlage	913.442.943	96,21	
Sonstiges N	Nettoverm	36.022.074	3,79	
Nettoinven	itarwert		949.465.017	100,00

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nenn-	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö-
betrag Aktien	-wanrung	Zugerasserr sinu		gens
Belgien			6.719.744	0,92
213.277	EUR	Azelis Group	6.719.744	0,92
Brasilien			16.264.935	2,22
12.200	BRL	Aeris Industria E Comercio de Equipamentos Para Geracao de Energia	17.900	
1.405.200	BRL	B3 - Brasil Bolsa Balcao	3.287.380	0,45
26.693	BRL	Banco do Brasil	141.657	0,02
59.090	BRL	BR Malls Participacoes	87.673	0,01
5.300	BRL	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista	23.669	_
19.406	USD	Itau Unibanco Holding	102.270	0,01
1.893.000	BRL	Itausa	3.872.381	0,53
269.182	BRL	Lojas Renner	1.701.372	0,23
1.638.300	BRL	Raia Drogasil	7.030.633	0,97
Kanada			2.796	-
704	CAD	Loop Energy	2.796	
Chile			1.974.186	0,27
237.841	CLP	Empresas COPEC	1.974.186	0,27
China			51.860.663	7,09
12.989	CNH	Advanced Micro- Fabrication Equipment	305.792	0,04
58.600	CNH	Autobio Diagnostics	484.399	0,07
123.600	HKD	Baozun	722.422	0,10
377.000	HKD	Budweiser Brewing	955.981	0,13
41.300	CNH	BYD	1.598.146	0,22
12.600	HKD	China Gas Holdings	37.227	0,01
642.373	CNH	China Jushi	1.751.397	0,24
292.000	HKD	China Mengniu Dairy	1.881.112	0,26
94.700	CNH	China Tourism Group Duty Free	3.818.578	0,52
25.400	CNH	Contemporary Amperex Technology	2.070.975	0,28
222.200	CNH	Estun Automation	755.376	0,10
13.800	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	235.424	0,03
50.988	CNH	Gongniu Group	1.290.921	0,18
348.195	CNH	Gree Real Estate	392.046	0,05
442.500	CNH	Huafon Chemical	835.184	0,11
237.458	CNH	JCET Group	1.181.039	0,16
135.860	CNH	Jiangsu Hengrui Medicine	1.058.359	0,14
23.538	USD	JinkoSolar Holding	1.078.276	0,15



Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der und Geldmarktinst			Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
58.716	CNH	Keboda Technology	515.863	0,07
4.800	CNH	Kweichow Moutai	1.362.293	0,19
237.400	CNH	LB Group	1.057.042	0,14
244.520	CNH	LONGi Green Energy Technology	3.127.817	0,43
763.367	CNH	Midea Group	8.239.880	1,13
65.385	CNH	Oppein Home Group	1.327.078	0,18
130.000	HKD	PICC Property & Casualty	126.081	0,02
244.300	CNH	Sany Heavy Industry	963.871	0,13
48.100	CNH	SF Holding	487.494	0,07
26.553	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	169.458	0,02
80.704	CNH	Shanghai Kelai Mechatronics Engineering	411.283	0,06
144.400	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1.410.867	0,19
34.500	CNH	Shenzhen Kangtai Biological Products	589.255	0,08
140.457	CNH	Shenzhen Senior Technology Material	981.333	0,13
112.218	CNH	Shenzhen Sunlord Electronics	590.507	0,08
20.400	CNH	Skshu Paint	316.380	0,04
2.200	HKD	Tencent Holdings	130.395	0,02
145.868	CNH	Thunder Software Technology	2.832.096	0,39
56.376	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	610.453	0,08
153.000	CNH	Yunnan Baiyao Group	2.320.407	0,32
149.100	CNH	Zhejiang Dingli Machinery	1.630.216	0,22
161.847	CNH	Zhejiang Jiecang Linear Motion Technology	1.065.769	0,15
203.000	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	1.142.171	0,16
Tschechisc	he Republi	k	2.069.678	0,28
51.074	CZK	Komercni banka	2.069.678	0,28
Ägypten			1.417.391	0,19
490.091	USD	Commercial International Bank Egypt	1.308.543	0,18
231.228	EGP	Talaat Moustafa Group	108.848	0,01
Georgien			4.920.895	0,67
186.356	GBP	Georgia Capital	1.506.576	0,21
174.759	GBP	TBC Bank Group	3.414.319	0,46
Griechenla	nd		8.798.877	1,20
3.845.960	EUR	Alpha Services & Holdings	4.878.189	0,67
1.113.135	EUR	Eurobank Ergasias Services & Holdings	1.044.414	0,14

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.021.260	EUR	National Bank of Greece	2.862.803	0,39
1.013	EUR	Terna Energy	13.471	_
Ungarn			14.057.197	1,92
130.091	HUF	OTP Bank	7.630.979	1,04
234.986	HUF	Richter Gedeon	6.426.218	0,88
Indonesien			9.564.132	1,31
2.515.900	IDR	Bank Central Asia	6.152.420	0,84
6.309.300	IDR	Bank Mandiri Persero	2.711.070	0,37
2.717.600	IDR	Telekomunikasi Indonesia Persero	700.642	0,10
Italien			13.568.159	1,85
15.460	EUR	Amplifon	737.813	0,10
4.629	EUR	DiaSorin	972.399	0,13
228.653	EUR	Eni	3.058.077	0,41
9.010	EUR	Falck Renewables	70.187	0,01
113.673	EUR	FinecoBank Banca Fineco	2.063.318	0,28
63.471	EUR	GVS	904.316	0,12
815.128	EUR	Intesa Sanpaolo	2.316.603	0,32
20.847	EUR	Moncler	1.280.333	0,18
18.828	EUR	Nexi	352.440	0,05
16.606	EUR	Philogen	266.990	0,04
42.680	EUR	Prysmian	1.498.972	0,20
6.572	EUR	Terna-Rete Elettrica Nazionale	46.711	0,01
Japan	-		458.781	0,06
14.800	JPY	WealthNavi	458.781	0,06
Kasachstan	1		8.390.534	1,15
316.363	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	5.378.171	0,74
28.365	USD	Kaspi.KZ JSC	3.012.363	0,41
Kenia			1.621.692	0,22
4.216.400	KES	Safaricom	1.621.692	0,22
Mexiko			366.553	0,05
26.068	USD	Banco Santander Mexico Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	149.370	0,02
64.162	MXN	Corp Moctezuma SAB de CV	217.183	0,03
Niederland	е		517.444	0,07
6.126	EUR	EXOR	517.444	0,07
Philippinen	1		4.114.503	0,56
650.320	PHP	Ayala Land	427.087	0,06
277.290	PHP	International Container Terminal Services	1.060.019	0,14

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	
280.460	PHP	Universal Robina	747.197	0,10	172.541	KRW	Samsung Electronics- Preference	10 142 612	1 40
3.487.600	PHP	Wilcon Depot	1.880.200	0,26	17.444	KRW	Samsung Fire & Marine	10.142.613	1,40
Polen			24.180.215	3,31	.,,,,,		Insurance	3.462.280	0,47
1.724.318	PLN	Bank Millennium	2.922.095	0,40	2.274	KRW	Samsung SDI	1.378.997	0,19
101.186	PLN	CCC	3.075.841	0,42	26.250	KRW	SK Hynix	2.283.573	0,31
16.972	PLN	KGHM Polska Miedz	672.735	0,09	4.033	KRW	SK Telecom	1.103.625	0,15
44.170	PLN	KRUK	3.607.119	0,49	Spanien			57.304	0,01
934	PLN	LPP	3.475.567	0,48	1.181	EUR	Corp ACCIONA Energias Renovables	20 756	0,01
46.534	PLN	mBank	4.808.719	0,66	2.299	EUR		38.756	
313.783	PLN	Powszechna Kasa Oszczedności Bank Polski	3.332.502	0,46	Schweden	LOIC	Soltec Power Holdings	18.548	
17.266	PLN	TEN Square Games	2.285.637	0,31	4.848	SEK	OX2	27.412 27.412	
Russland		TEN Square dames	88.300.376	12,08	Schweiz	JLK	UAZ	2.508.991	
77.525	USD	Fix Price Group	696.562	0,10	592.942	ZAR	Mediclinic International	2.508.991	0,34 0,34
1.174.241	USD	Gazprom	11.725.971	1,60	Taiwan		Mediciinic International		14,54
115.292	USD	LUKOIL	11.047.279	1,51	187.792	TWD	Advantech	2.460.260	0,34
309.462	USD	Magnit	5.214.435	0,71	33.000	TWD	Andes Technology	471.420	0,34
60.081	USD	MMC Norilsk Nickel	1.798.224	0,25	890.000	TWD	3,		0,08
40.671	USD	Novatek	10.741.211	1,47	425.000	TWD	ASE Technology Holding Chroma ATE	3.481.991	0,48
21.087	USD	Novatek-GDR	5.569.077	0,76	845.000	TWD	CTBC Financial Holding	2.684.805 694.550	0,37
145.986	GBP	Polymetal International	2.474.505	0,34	28.250	TWD	Dadi Early-Childhood	094.550	0,09
6.073	USD	Polyus	499.201	0,07			Education Group	155.139	0,02
766.949	USD	Rosneft Oil	6.480.719	0,89	111.000	TWD	Delta Electronics	1.004.002	0,14
704.212	USD	Sberbank of Russia	13.253.270	1,82	369.000	TWD	Formosa Plastics	1.503.257	0,21
88.019	USD	TCS Group Holding	8.080.144	1,10	984.000	TWD	Getac Technology	1.825.983	0,25
72.618	USD	X5 Retail Group	2.357.906	0,32	70.990	TWD	Hiwin Technologies	788.622	0,11
104.930	USD	Yandex	8.361.872	1,14	1.088.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	4.100.429	0,56
Slowenien			6.282.081	0,86	433.000	TWD	MediaTek	14.065.254	1,92
371.459	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	6.282.081	0,86	196.000	TWD	Mega Financial Holding	225.473	0,03
Südafrika		<u>. </u>	2.260.084	0,31	234.000	TWD	Merida Industry	2.456.704	0,34
17.399	ZAR	Capitec Bank Holdings	2.101.803	0,29	215.000	TWD	Nien Made Enterprise	3.055.939	0,42
36.948	ZAR	FirstRand	158.281	0,02	218.000	TWD	Novatek		,
Südkorea			57.263.747	7,83			Microelectronics	3.208.126	0,44
10.054	KRW	Hana Financial Group	394.008	0,05	310	USD	Sea	98.806	0,01
9.818	KRW	KB Financial Group	458.560	0,06	138.750	TWD	Sporton International	1.090.657	0,15
6.228	KRW	Korea Zinc	2.645.848	0,36	2.706.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	56.333.519	7,71
11.242	KRW	LG Chem	7.368.068	1,01	73.000	TWD	TCI	596.095	0,08
1.148	KRW	LG Chem-Preference	364.083	0,05	400.000	TWD	Uni-President	330.033	0,00
1.640	KRW	LG Household & Health Care	1.851.926	0,25	55.000	TWD	Enterprises Universal Vision	980.600	0,13
8.652	KRW	LG Uplus	109.611	0,01			Biotechnology	610.003	0,08
15.709	KRW	NAVER	5.147.882	0,70	348.000	TWD	Vanguard International Semiconductor	1.892.357	0,26
328.399	KRW	Samsung Electronics	20.552.673	2,82	40.650	TWD	Voltronic Power Technology	2.494.984	0,34



Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Thailand			5.196.198	0,71
512.800	THB	Kasikornbank	2.023.313	0,28
700.000	THB	Kasikornbank-XDR	2.761.933	0,37
1.749.000	THB	Land & Houses	410.952	0,06
Türkei			22.629.246	3,09
278.233	TRY	Coca-Cola Icecek	2.656.244	0,36
2.507.476	TRY	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	4.694.645	0,64
374.512	TRY	Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret	2.712.085	0,37
270.190	TRY	Migros Ticaret	957.651	0,13
1.080.273	TRY	MLP Saglik Hizmetleri	3.338.120	0,46
1.809.647	TRY	Sok Marketler Ticaret	2.401.196	0,33
1.003.764	TRY	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi	5.869.305	0,80
Vereinigte	Arabische	Emirate	226.994	0,03
204.359	AED	Emaar Properties	226.994	0,03
Vereinigtes	Königreic	h	15.934.753	2,18
99.712	EUR	CNH Industrial	1.697.870	0,23
391.272	GBP	de La Rue	970.048	0,13
124.333	GBP	Gresham House	1.519.463	0,21
398.780	GBP	Melrose Industries	935.199	0,13
461.167	PLN	Pepco Group	5.913.512	0,81
38.035	GBP	Rathbone Brothers	1.032.654	0,14
2.760	GBP	Saietta Group	8.832	0
78.210	GBP	Science in Sport	81.670	0,01
416.587	GBP	TT Electronics	1.456.598	0,20
143.341	GBP	Vesuvius	942.512	0,13
107.983	GBP	Watches of Switzerland Group	1.376.395	0,19
Vereinigte	Staaten		18.339.705	2,51
2.212	USD	Array Technologies	40.966	0,01
347.787	GBP	Avast	2.660.757	0,36
4.124	USD	First Republic Bank	795.437	0,11
162.572	PLN	HUUUGE	1.667.720	0,23
14.348	USD	Mastercard	4.988.513	0,68
14.000	TWD	Parade Technologies	831.643	0,11
7.684	USD	Privia Health Group	181.035	0,02
20.506	USD	Silverback Therapeutics	204.650	0,03
21.527	EUR	Stellantis	411.989	0,06
17.689	USD	TuSimple Holdings	656.793	0,09
26.488	USD	Visa	5.900.202	0,81
Summe Akt	tien		496.174.241	67,83

		Übertragbare Wertpapiere		
Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Argentinie	n		160.609	0,02
173.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/01/38, 2.00%	67.532	0,01
34.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50%	12.556	_
241.741	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/46, 1.13%	80.521	0,01
Brasilien			317.714	0,04
1.256.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	227.203	0,03
510.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	90.511	0,01
China			129.294	0,02
200.000	USD	Yuzhou Group Holdings 13/01/27, 6.35%	129.294	0,02
Kolumbien			231.081	0,03
928.400.000	COP	Colombian TES 30/06/32, 7.00%	231.081	0,03
Ecuador			237.865	0,03
270.319	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/35, 1.00%	179.426	0,02
100.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 0.50%	58.439	0,01
Ägypten			101.523	0,01
1.450.000	EGP	Egypt Government Bond 09/05/27, 17.18%	101.523	0,01
Indonesien	1		549.692	0,08
4.100.000.000) IDR	Indonesia Treasury Bond 15/09/30, 7.00%	300.930	0,05
2.100.000.000) IDR	Indonesia Treasury Bond 15/06/36, 6.25%	144.986	0,02
1.260.000.000) IDR	Indonesia Treasury Bond 15/02/44, 8.75%	103.776	0,01
Elfenbeink	üste		242.220	0,03
200.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	242.220	0,03
Mexiko		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	727.344	0,11
1.800.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	92.955	0,01
3.600.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/42, 7.75%	172.751	0,02

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.750.000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	85.546	0,01
3.800.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/09/24, 7.19%	175.858	0,03
4.600.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	200.234	0,04
Russland			216.860	0,03
8.400.000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 17/05/28, 5.70%	107.033	0,01
7.750.000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 10/04/30, 7.65%	109.827	0,02
Südafrika			529.117	0,07
2.740.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/30, 8.00%	169.236	0,03
1.650.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	98.075	0,01
2.700.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	159.309	0,02
1.840.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	102.497	0,01
Supranatio	nal		99.209	0,01
7.120.000	INR	International Finance 25/11/24, 6.30%	99.209	0,01
Türkei			211.810	0,03
200.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi		
		30/04/26, 9.25%	211.810	0,03
Ukraine			268.796	0,04
1.860.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/02/25, 15.84%	75.713	0,01
2.590.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/05/27, 9.79%	84.485	0,01
100.000	USD	Ukraine Government International Bond 01/09/27, 7.75%	108.598	0,02
Summe An	leihen		4.023.134	0,55
Geldmarkti	instrumen	Wertpapiere und te, die zu einer amtlichen elassen sind	500.197.375	68,38

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte	Staaten		124.994.395	17,09
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 07/10/21, ZCP	19.999.863	2,74
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 14/10/21, ZCP	14.999.764	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 21/10/21, ZCP	14.999.663	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 12/11/21, ZCP	14.999.131	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 26/11/21, ZCP	14.999.242	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 02/12/21, ZCP	14.999.040	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 09/12/21, ZCP	14.998.864	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/12/21, ZCP	14.998.828	2,05
Summe An	leihen		124.994.395	17,09
Geldmarkti	instrumen	Wertpapiere und te, die an einem anderen		
geregelten	Markt geh	andelt werden	124.994.395	17,09

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Hongkong			7.341.917	1,00
17.146	USD	Schroder Umbrella Fund II-China Equity Alpha		
		Fund	7.341.917	1,00
Luxemburg	l		18.882.739	2,58
28.006	USD	Schroder ISF Indian Equity	10.458.205	1,43
76.669	USD	Schroder ISF Securitised Credit	8.424.534	1,15
Summe der Organisme		n offenen einsame Anlagen	26.224.656	3,58

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Russland			1.546.831	0,21
154.900	USD	Gazprom	1.546.831	0,21
Summe Akt	ien		1.546.831	0,21
Summe son	stige Wer	tpapiere	1.546.831	0,21
Summe Kap	oitalanlage	en	652.963.257	89,26
Sonstiges N	Sonstiges Nettovermögen			10,74
Nettoinven	tarwert		731.532.901	100,00



Schroder GAIA Oaktree Credit*

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag Anleihen	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Argentinie	n		1.065.336	3,72
250.000	USD	Transportadora de Gas del Sur 02/05/25, 6.75%	233.625	0,82
775.000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	601.931	2,10
250.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	229.780	0,80
Kanada			120.213	0,42
100.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	120.213	0,42
Frankreich			708.151	2,47
100.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	119.235	0,42
100.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	114.311	0,40
100.000	EUR	Banijay Entertainment 01/03/25, 3.50%	117.315	0,41
100.000	EUR	Chrome Bidco 31/05/28, 3.50%	118.658	0,41
100.000	EUR	Laboratoire Eimer Selas 01/02/29, 5.00%	119.959	0,42
100.000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	118.673	0,41
Deutschlar	nd 		235.999	0,82
100.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/01/28, 4.38%	120.689	0,42
100.000	EUR	Nidda Healthcare Holding 30/09/24, 3.50%	115.310	0,40
Irland			113.646	0,40
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	113.646	0,40
Italien			237.451	0,83
100.000	EUR	Brunello Bidco 15/02/28, 3.50%	115.933	0,40
100.000	EUR	Centurion Bidco 30/09/26, 5.88%	121.518	0,43
Luxemburg)		693.634	2,42
100.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	109.325	0,38
95.000	USD	ARD Finance 30/06/27, 6.50%	100.938	0,35
100.000	EUR	INEOS Finance 01/05/26, 2.88%	116.993	0,41
100.000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	118.853	0,42
100.000	EUR	Monitchem HoldCo 2 15/09/26, 9.50%	125.898	0,44
100.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	121.627	0,42
Niederland	le		474.396	1,66
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	118.801	0,41

Anzahl der Anteile oder Nenn-		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung	Markt- wert	% des Netto- vermö-
betrag	Währung	zugelassen sind	USD	gens
115.000	USD	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 5.50%	120.585	0,43
100.000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3.88%	119.175	0,42
100.000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3.38%	115.835	0,40
Spanien		<u> </u>	468.057	1,64
100.000	EUR	Cirsa Finance International		<u> </u>
100.000	EUR	15/03/27, 4.50% eDreams ODIGEO 01/09/23, 5.50%	114.819 116.496	0,40
100.000	EUR	Grifols Escrow Issuer 15/10/28, 3.88%	117.343	0,41
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	119.399	0,42
Schweden		,	234.785	0,82
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden perpetual, variabel	115.811	0,40
100.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3.88%	118.974	0,42
Vereinigtes	Königreic	h	683.192	2,39
100.000	GBP	AA Bond 31/01/26, 6.50%	141.876	0,50
100.000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8.00%	145.256	0,51
100.000	EUR	INEOS Quattro Finance 1 15/07/26, 3.75%	119.247	0,42
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3.50%	135.903	0,47
100.000	GBP	Thames Water Kemble Finance 19/05/26, 4.63%	140.910	0,49
Vereinigte	Staaten		865.322	3,02
105.000	USD	Covanta Holding 01/09/30, 5.00%	106.185	0,37
100.000	EUR	Energizer Gamma Acquisition 30/06/29, 3.50%	115.176	0,40
55.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6.00%	55.928	0,20
115.000	USD	Olin 01/08/29, 5.63%	126.571	0,44
135.000	USD	PG&E 01/10/28, 5.00%	137.306	0,48
100.000	EUR	Scientific Games International		
200.000	USD	15/02/26, 3.38% TransDigm 15/11/27, 5.50%	117.144 207.012	0,41
Summe An	loiben	13/11/27, 3.30%		0,72
		Wertpapiere und	5.900.182	20,61
Geldmarkti	instrumen	te, die zu einer amtlichen elassen sind	5.900.182	20,61

Finance 15/08/26, 3.75% 118.801 0,41

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

Schroder GAIA Oaktree Credit* (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen					Irland			3.849.080	13,45
Argentinie	1		387.004	1,35	375.000	EUR	Ares European CLO XII		
400.000	USD	Telecom Argentina 06/08/25, 8.50%	387.004	1,35	250.000	EUR	DAC 20/04/32, variabel BBAM European CLO I	433.358	1,51
Australien			388.176	1,36			DAC 22/07/34, variabel	284.297	0,99
262.000	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	190.575	0,67	300.000	EUR	Bluemountain Fuji Eur CLO IV DAC 25/02/34, variabel	345.345	1,21
272.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	197.601	0,69	375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC	420.400	4.50
Brasilien		Variabei	191.308	0,67	470.000	FLID	20/07/34, variabel	428.190	1,50
200.000	USD	Azul Investments 15/06/26, 7.25%	191.308	0,67	178.000	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	206.527	0,72
Kanada		13/00/20, 7.23%			161.000	EUR	Last Mile Logistics Pan	200,027	37.2
90.000	USD	Bombardier 15/06/26,	693.163	2,42			Euro Finance Series1A 17/08/33, variabel	187.520	0,66
165.000	USD	7.13% Cascades 15/01/28, 5.38%	94.838 173.666	0,33 0,61	375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35. variabel	422.057	1 40
200.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	209.790	0,73	375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	422.857 435.633	1,48 1,53
55.000	USD	MEG Energy 01/02/27, 7.13%	57.816	0,20	250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	292.987	1,02
90.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	92.552	0,32	288.000	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	390.475	1,36
65.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	64.501	0,23	375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	421.891	1,47
Kaimaninse	eln		2.984.157	10,42	Luxemburg	9		338.222	1,18
250.000 250.000	USD USD	ACAM 17/11/34, variabel ACAM Series 2019-FL1	233.442	0,82	200.000	USD	Intelsat Jackson Holdings 15/02/24, 8.00%**	205.500	0,72
250.000	USD	17/11/34, variabel Arbor Realty Commercial Real Estate Notes	238.038	0,83	130.000	USD	ION Trading Technologies		·
		15/05/36, variabel	253.472	0,89			15/05/28, 5.75%	132.722	0,46
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	358.619	1,25	Vereinigte			137.656	0,48
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	371.089	1,29	100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	137.656	0,48
250.000	USD	MP CLO VIII		,	Vereinigte	Staaten		13.141.892	45,90
250.000	USD	28/04/34, variabel Ocean Trails CLO XI	251.109	0,88	195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	210.844	0,74
250.000	USD	20/07/34, variabel Ocean Trails CLO	247.877	0,87	125.000	USD	Acadia Healthcare 01/07/28, 5.50%	131.558	0,46
		XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	251.326	0,88	65.000	USD	Acadia Healthcare 15/04/29, 5.00%	67.765	0,24
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	376.819	1,31	170.000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	171.533	0,60
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	402.366	1,40	25.000	USD	Albertsons 15/01/27, 4.63%	26.257	0,09
Deutschlan			127.813	0,45	160.000	USD	Albertsons	170 600	0.00
125.000	USD	Mercer International 01/02/29, 5.13%	127.813	0,45	50.000	USD	15/02/28, 5.88% Allied Universal 01/06/28, 4.63%	170.600 49.985	0,60

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



^{**} Notleidendes Wertpapier.

Schroder GAIA Oaktree Credit* (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
125.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	132.316	0,46	65.000	USD	CrownRock 01/05/29, 5.00%	67.948	0,24
55.000	USD	Ambience Merger Sub 15/07/29, 7.13%	54.931	0,19	135.000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower	146.644	0.51
30.000	USD	American Airlines 15/07/25, 11.75%	37.163	0,13	40.000	USD	15/05/28, 6.75% Diamond 01/10/29, 4.63%	146.644 40.651	0,51
175.000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	186.296	0,65	95.000	USD	DIRECTV Holdings 15/08/27, 5.88%	99.275	0,14
165.000	USD	Aramark Services 01/02/28, 5.00%	169.759	0,59	195.000	USD	Edgewell Personal Care 01/06/28, 5.50%	206.189	0,33
165.000	USD	Arconic 15/02/28, 6.13%	175.110	0,61	400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust	200.103	0,72
25.000	USD	Ascent Resources Utica Holdings	05.075		145.000	USD	25/07/26, variabel Fortress Transportation	399.858	1,40
60.000	USD	01/11/26, 7.00% Ascent Resources Utica Holdings	25.875	0,09	145.000	030	and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	146.641	0,51
		31/12/28, 8.25%	65.497	0,23	120.000	USD	Frontier	1 10.0 11	0,51
40.000	USD	AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	40.307	0,14	120.000	035	Communications Holdings		
71.000	USD	Bausch Health 15/04/25, 6.13%	72.510	0,25	05.000	LICD	01/05/28, 5.00%	126.150	0,44
80.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	83.000	0,29	85.000	USD	Frontier Communications Holdings		
371.094	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	372.273	1,30	95.000	USD	01/05/29, 6.75% Golden Nugget	89.696	0,31
250.000	USD	BRSP 19/08/38, variabel	250.467	0,87			15/10/24, 6.75%	95.242	0,33
145.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	145.751	0,51	135.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	142.115	0,50
145.000	USD	Calpine 15/03/28, 5.13%	147.028	0,51	160.000	USD	Hawaiian Brand Intellectual Property		
110.000	USD	Churchill Downs 15/01/28, 4.75%	115.225	0,40	165.000	USD	20/01/26, 5.75% Helios Software Holdings	167.600	0,59
130.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	133.103	0,46			01/05/28, 4.63%	162.731	0,57
75.000	USD	Colgate Energy Partners			65.000	USD	Herbalife International 01/06/29, 4.88%	65.081	0,23
45.000	USD	III 15/02/26, 7.75% CommScope	79.097 46.080	0,28	125.000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	130.725	0,46
145.000	USD	01/07/28, 7.13% CommScope	40.000	0,16	150.000	USD	Hilton Grand Vacations	130.723	0,40
145.000	030	Technologies 15/06/25, 6.00%	147.285	0,51	.55,555	332	Borrower Escrow 01/06/29, 5.00%	153.188	0,54
130.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	136.289	0,48	25.000	USD	iHeartcommunications 01/05/27, 8.38%	26.750	0,09
200.000	USD	Compass Group Diversified Holdings			165.000	USD	iHeartcommunications 15/08/27, 5.25%	171.806	0,60
35.000	USD	15/04/29, 5.25% Comstock Resources	209.500	0,73	165.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	172.631	0,60
165.000	USD	15/01/30, 5.88% Consolidated	36.449	0,13	25.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	26.089	0,09
103.000	030	Communications 01/10/28, 6.50%	179.441	0,63	125.000	USD	KAR Auction Services 01/06/25, 5.13%	126.563	0,44
120.000	USD	Constellium 15/06/28, 5.63%	126.287	0,44	95.000	USD	Kennedy-Wilson 01/03/29, 4.75%	96.781	0,34
65.000	USD	Coty 15/04/26, 5.00%	66.482	0,23	400.000	USD	Kennedy-Wilson		
115.000	USD	CQP 15/06/31, 5.50%	122.452	0,43			01/02/30, 4.75%	407.499	1,42

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

Schroder GAIA Oaktree Credit* (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
200.000	USD	Legends Hospitality Holding 01/02/26, 5.00%	205.326	0,72	95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	99.394	0,35
130.000	USD	MEDNAX			135.000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	134.494	0,47
145.000	USD	15/01/27, 6.25% Minerals Technologies	136.825	0,48	110.000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	118.113	0,41
80.000	USD	01/07/28, 5.00% MPH Acquisition	150.619	0,53	40.000	USD	Unifrax Escrow Issuer 30/09/28, 5.25%	40.651	0,14
		Holdings 01/11/28, 5.75%	75.479	0,26	160.000	USD	Univision Communications	.0.00	3,
25.000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	25.577	0,09			01/06/27, 6.63%	174.000	0,61
160.000	USD	NCR 01/09/29, 6.13%	173.800	0,61	175.000	USD	US Foods 15/02/29, 4.75%	179.831	0,63
85.000	USD	Nexstar Media 15/07/27, 5.63%	90.126	0,31	10.000	USD	Venture Global Calcasieu Pass 15/08/29, 3.88%	10.313	0,04
120.000 45.000	USD USD	NFP 15/08/28, 4.88% Olympus Water US	121.650	0,42	15.000	USD	Venture Global Calcasieu Pass 15/08/31, 4.13%	15.656	0,05
10.000	USD	Holding 01/10/28, 4.25% Olympus Water US	44.382	0,16	80.000	USD	Vine Energy Holdings		
120.000	USD	Holding 01/10/29, 6.25% Ortho-Clinical	9.922	0,03	70.000	USD	15/04/29, 6.75% Vista Outdoor	86.500	0,30
120.000	030	Diagnostics 01/06/25, 7.38%	126.787	0,44	170.000	USD	15/03/29, 4.50% VM Consolidated	71.072	0,25
180.000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	188.696	0,66	189.000	USD	15/04/29, 5.50% VMC Finance	173.144	0,60
140.000	USD	Pike 01/09/28, 5.50%	142.854	0,50	455.000		16/06/36, variabel	189.334	0,66
140.000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	147.259	0,51	455.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	458.265	1,61
195.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	201.854	0,71	185.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	192.863	0,67
250.000	USD	PRPM 25/06/26, 3.72%	249.833	0,87	180.000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	192.901	0,67
200.000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	200.345	0,70	130.000	USD	Xerox Holdings	152.501	0,07
55.000	USD	Realogy Group 15/01/29, 5.75%	57.125	0,20	Summe An		15/08/25, 5.00%	136.760	0,48
135.000	USD	Sabre GLBL			Summe üb	ertragbare	e Wertpapiere und	22.238.471	77,68
85.000	USD	01/09/25, 7.38% Scripps Escrow II	144.275	0,50			ite, die an einem anderen handelt werden	22.238.471	77,68
		15/01/31, 5.38%	83.693	0,29	Summe Ka	pitalanlag	en	28.138.653	98,29
165.000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5.63%	172.219	0,60	Sonstiges N		ögen	488.258	1,71
160.000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5.50%	173.200	0,61	Nettoinver	itarwert		28.626.911	100,00
85.000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	87.869	0,31					
65.000	USD	Suburban Propane Partners 01/06/31, 5.00%	67.519	0,24					
130.000	USD	Summit Materials Finance 15/01/29, 5.25%	136.663	0,48					
25.000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6.25%	25.969	0,09					
				,					

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

0,62

176.367

Die Anmerkungen auf den Seiten 63 bis 143 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



170.000

Tenet Healthcare

15/06/28, 4.63%

USD

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Üb un die Bö zug
Aktien					166.685	USD	IHS
Frankreich			6.799.707	2,01	44.530	USD	Jar
24.988	EUR	Airbus	3.331.551	0,99	90.920	USD	Joh
24.902	EUR	BNP Paribas	1.599.180	0,47	04.741	USD	Int
27.704	EUR	Cie de Saint-Gobain	1.868.976	0,55	84.741		Ke
Israel			1.600.968	0,47	12.395	USD	Ke
77.906	USD	Cognyte Software	1.600.968	0,47	15.660	USD	Ko
Spanien			13.770.934	4,07	25.023	USD	Lo
223.047	EUR	Cellnex Telecom	13.770.934	4,07	27.680	USD	Má
Schweden			3.839.072	1,13	16.006	USD	Má
339.140	SEK	Telefonaktiebolaget LM			3.777	USD	Ma
		Ericsson	3.839.072	1,13	75.630	USD	Me
Vereinigtes			22.323.952	6,59	19.554	USD	Mi
6.940	EUR	Linde	2.058.775	0,61	22.806	USD	NI
201.882	GBP	London Stock Exchange Group	20.265.177	5,98	12.835	USD	Ole
Vereinigte :	Staaten		258.556.938	76,36	184.628	USD	10
57.729	USD	Abbott Laboratories	6.819.527	2,01	79.992	USD	Op
170.912	USD	Allison Transmission	0.0.7.027	_, .	64.369	USD	PA
		Holdings	6.036.612	1,78	31.056	USD	Pa
3.671	USD	Alphabet	9.814.492	2,90	4.377	USD	Pa
883	USD	Amazon.com	2.900.690	0,86	24.782	USD	Po
34.091	USD	Anterix	2.069.324	0,61	32.384	USD	PT
29.309	USD	AZEK	1.070.658	0,32	69.489	USD	Qι
189.216	USD	Baker Hughes	4.679.312	1,38	10.653	USD	Ro
19.308	USD	Berry Global Group	1.175.471	0,35	64.094	USD	Ro
30.669	USD	BJ's Wholesale Club Holdings	1.684.341	0,50	1.766	USD	S&
138.295	USD	Boston Scientific	6.000.620	1,77	147.825	USD	Sa
28.937	USD	Bumble	1.446.271	0,43	114.288	USD	Sc
3.308	USD	Bunge	675.607	0,20	22.764	USD	Se
250.066	USD	Carnival	6.254.151	1,85	6.444	USD	Sh
7.464	USD	ConocoPhillips	505.835	0,15	176.210	USD	So
63.784	USD	Constellation Brands	13.438.651	3,97	14.094	USD	Sp
12.806	USD	Crown Holdings	1.290.589	0,38	26.704	USD	T-I
19.362	USD	CyberArk Software	3.055.711	0,58	210.891	USD	Ve
23.722	USD	Danaher			12.303	USD	Wa
3.242	USD		7.221.926	2,13	21.975	USD	Wa
56.003	USD	Darling Ingredients DR Horton	233.100 4.702.572	0,07	307.160	USD	We
29.053	USD	Dropbox		1,39	83.881	USD	Wi
12.360	USD	'	848.929	0,25	36.700	USD	W
14.102	USD	Eagle Materials	1.621.138	0,48			En
28.539	USD	Element Solutions	305.731	0,09	Summe Ak	tien	
		Eli Lilly	6.593.936	1,95	Summe üb	_	
8.431	USD	General Mills	504.342	0,15	Geldmarkt Börsennoti		
12.164	USD	Hasbro	1.085.272	0,32	20.30	ang zug	J.W.

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
166.685	USD	IHS Markit	19.438.804	5,73
44.530	USD	Janus Henderson Group	1.840.425	0,54
90.920	USD	Johnson Controls International	6.189.834	1,83
84.741	USD	KeyCorp	1.832.100	0,54
12.395	USD	Keysight Technologies	2.036.375	0,60
15.660	USD	Kohl's	737.429	0,22
25.023	USD	Lowe's	5.076.166	1,50
27.680	USD	Marvell Technology	1.669.381	0,49
16.006	USD	MasTec	1.380.998	0,41
3.777	USD	Mastercard	1.313.187	0,39
75.630	USD	Medtronic	9.480.221	2,80
19.554	USD	Microsoft	5.512.664	1,63
22.806	USD	NIKE	3.312.115	0,98
12.835	USD	Old Dominion Freight Line	3.670.553	1,08
184.628	USD	ON24	3.681.482	1,09
79.992	USD	Option Care Health	1.940.606	0,57
64.369	USD	PACCAR	5.080.001	1,50
31.056	USD	Papa John's International	3.943.801	1,16
4.377	USD	PayPal Holdings	1.138.939	0,34
24.782	USD	PotlatchDeltic	1.278.256	0,38
32.384	USD	PTC	3.879.279	1,15
69.489	USD	QUALCOMM	8.962.691	2,65
10.653	USD	Roper Technologies	4.752.623	1,40
64.094	USD	Royal Caribbean Cruises	5.701.161	1,68
1.766	USD	S&P Global	750.356	0,22
147.825	USD	Sabre	1.750.248	0,52
114.288	USD	Schlumberger	3.387.496	1,00
22.764	USD	Sealed Air	1.247.240	0,37
6.444	USD	Sherwin-Williams	1.802.580	0,53
176.210	USD	Southwest Airlines	9.062.480	2,68
14.094	USD	Splunk	2.039.543	0,60
26.704	USD	T-Mobile US	3.411.703	1,01
210.891	USD	Verra Mobility	3.178.127	0,94
12.303	USD	Walt Disney	2.081.299	0,61
21.975	USD	Waste Connections	2.767.312	0,82
307.160	USD	Wells Fargo	14.255.296	4,21
83.881	USD	Williams-Sonoma	14.874.617	4,39
36.700	USD	World Wrestling Entertainment	2.064.742	0,61
Summe Ak	tien		306.891.571	90,63
Geldmarkti	instrumen	Wertpapiere und te, die zu einer amtlichen elassen sind	306.891.571	90,63

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte	Staaten		2.655.083	0,78
2.946.000	USD	American Airlines Group 01/03/25, 3.75%	2.655.083	0,78
Summe An	leihen		2.655.083	0,78
Geldmarkt	instrumen	Wertpapiere und te, die an einem //arkt gehandelt werden	2.655.083	0,78
Summe Kapitalanlagen		309.546.654	91,41	
Sonstiges Nettovermögen		29.075.946	8,59	
Nettoinventarwert		338.622.600	100,00	

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Deutschlar	nd		111.718	0,02
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	20.276	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	21.796	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	19.129	_
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	17.754	_
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	18.136	_
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	14.627	_
Vereinigte	Staaten	<u> </u>	33.311	_
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	10.779	
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	11.741	_
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	10.791	_
Summe An	leihen		145.029	0,02
Geldmarkt	instrumen	Wertpapiere und te, die zu einer amtlichen elassen sind	145.029	0,02

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Österreich			89.997.025	9,91
90.000.000	USD	Austrian Treasury Bill 18/10/21, ZCP	89.997.025	9,91
Finnland			74.981.909	8,25
75.000.000	USD	Finland Treasury Bill 17/11/21, ZCP	74.981.909	8,25



Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Deutschlan	d		74.994.833	8,26
75.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 01/11/21, ZCP	74.994.833	8,26
Vereinigte	Staaten		34.071	_
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	11.509	_
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	11.763	_
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	10.799	_
Summe An	leihen		240.007.838	26,42
		Wertpapiere und te, die an einem anderen		
		nandelt werden	240.007.838	26,42

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Luxemburg]		5.000.000	0,55
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0.55
Summe Akt	tien		5.000.000	0,55
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			5.000.000	0,55
Summe Kaj	Summe Kapitalanlagen			26,99

Termineinlagen			
Finanzen		161.625.000	17,79
121.625.000 USD	Banque NA 01/10/21, 0.05%	121.625.000	13,39
40.000.000 USD	Mizuho Bank 01/10/21, 0.07%	40.000.000	4,40
Summe Termineinla	agen	161.625.000	17,79
Sonstiges Nettovermögen		501.610.963	55,22
Nettoinventarwert		908.388.830	100,00

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag Aktien	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% des Netto- vermö- gens
Vereinigtes	Köniareic	.h	9.930.571	30,83
25.191	GBP	AB Dynamics	508.858	1,58
1.296.958	GBP	Comptoir Group	101.163	0,31
292.006	GBP	Creo Medical Group	505.170	1,57
189.767	GBP	De La Rue	349.171	1,08
428.128	GBP	Everyman Media Group	599.379	1,86
21.625	GBP	GB Group	187.056	0,58
61.746	GBP	Gresham House	560.036	1,74
163.285	GBP	Hollywood Bowl Group	395.966	1,23
141.909	GBP	IG Design Group	688.259	2,14
232.130	GBP	Melrose Industries	404.022	1,25
8.113.909	GBP	Napster Group	105.481	0.33
18.663	GBP	Rathbone Brothers	376.059	1,17
598.233	GBP	Science in Sport	463.631	1,44
97.900	GBP	Secure Income Real Estate Investment Trust	408.243	1,27
202.739	GBP	TT Electronics	526.108	1,63
69.688	GBP	Vesuvius	340.077	1,06
65.594	GBP	Vitec Group	983.910	3,06
45.746	GBP	Vp	466.609	1,45
112.929	GBP	WANdisco	345.563	1,07
53.328	GBP	Watches of Switzerland Group	504.483	1,57
179.045	GBP	Wincanton	635.610	1,97
36.692	GBP	Young & Company's Brewery	323.257	1,00
9.900	GBP	Young & Company's Brewery Class A	152.460	0,47
Summe Akt	tien		9.930.571	30,83
Anleihen				
Vereinigtes	Königreic	h	18.964.204	58,88
1.700.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/03/22, 4.00%	1.729.409	5,37
4.650.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/22, 0.50%	4.663.718	14,48
3.100.000	GBP	United Kingdom Gilt 09/09/22, 1.75%	3.145.539	9,77
3.300.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/23, 0.75%	3.327.522	10,33
2.000.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/23, 2.25%	2.075.161	6,44
4.050.000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/24, 0.13%	4.022.855	12,49
Summe Anl			18.964.204	58,88
Geldmarkti	instrumen	Wertpapiere und te, die zu einer amtlichen elassen sind	28.894.775	89,71
Summe Kap	pitalanlage	en	28.894.775	89,71
Sonstiges N	lettoverm	ögen	3.313.711	10,29
Nettoinven	tarwert		32.208.486	100,00

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Australien			852.604	0,21
162.034	AUD	Bellevue Gold	98.985	0,02
128.167	GBP	Glencore	607.618	0,15
15.499	AUD	Vulcan Energy Resources	146.001	0,04
Österreich			3.460.082	0,84
18.289	EUR	Addiko Bank	288.117	0,07
34.801	EUR	BAWAG Group	2.219.161	0,54
21.612	EUR	Erste Group Bank	952.804	0,23
Belgien			1.639.701	0,40
7.921	EUR	Galapagos	414.356	0,10
3.888	EUR	KBC Ancora	199.512	0,05
11.348	EUR	KBC Group	1.025.833	0,25
Brasilien			623.800	0,15
15.529	USD	XP	623.800	0,15
Kanada			12.074.604	2,93
279.878	CAD	ARC Resources	2.622.889	0,65
2.077	USD	Cameco	45.133	0,01
2.503	USD	Canadian Natural Resources	91.460	0,02
37.765	USD	Cenovus Energy	379.916	0,09
3.200	USD	Clementia Pharmaceuticals	_	_
14.651	CAD	Enerplus	117.291	0,03
153.940	CAD	Headwater Exploration	552.998	0,13
18.085	CAD	Intact Financial	2.391.343	0,58
2.390	CAD	Keyera	60.137	0,01
5.896	CAD	Nuvei	675.438	0,16
32.652	CAD	Parex Resources	593.954	0,14
423.683	CAD	Storm Resources	1.806.323	0,44
24.052	USD	Suncor Energy	498.838	0,12
2.509	CAD	Teck Resources	62.458	0,02
6.228	USD	Teck Resources	155.139	0,04
44.039	CAD	Tourmaline Oil	1.538.549	0,37
3.317	CAD	West Fraser Timber	279.376	0,07
26.775	CAD	Whitecap Resources	148.186	0,04
1.900	USD	Zymeworks	55.176	0,01
Kaimaninse	eln		61.311	0,01
6.269	USD	AEA-Bridges Impact	61.311	0,01
Chile			4.674	
87	USD	Sociedad Quimica y Minera de Chile	4.674	_

Anzahl der Anteile oder Nenn-		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung	Markt- wert	% des Netto- vermö-
betrag	Währung	zugelassen sind	USD	gens
China			5.427.450	1,32
40.000	HKD	Akeso	219.920	0,05
5.100	CNH	Amoy Diagnostics	63.434	0,02
630	HKD	Anhui Conch Cement	3.399	-
34.000	CNH	Anhui Conch Cement Class A	215.138	0,05
285	USD	BeiGene	103.455	0,03
36.246	HKD	China Gas Holdings	107.090	0,03
237.198	HKD	China Longyuan Power Group	586.241	0,14
3.250	HKD	China Merchants Port Holdings	5.578	_
62.518	HKD	China National Building Material	84.646	0,02
177.053	HKD	China Pacific Insurance		
11.629	HKD	Group China Petroleum &	526.520	0,13
		Chemical	5.766	-
3.400	HKD	China Shenhua Energy	7.958	-
10.856	USD	Connect Biopharma Holdings	259.458	0,06
5.866	CNH	Contemporary Amperex Technology	478.281	0,12
204.000	HKD	CSPC Pharmaceutical Group	244.759	0,06
35.353	HKD	Everest Medicines	223.436	0,05
157	CNH	Ganfeng Lithium	3.967	_
10.629	HKD	Ganfeng Lithium Class H	188.969	0,05
10.278	USD	Gracell Biotechnologies	142.556	0,03
7.724	HKD	Guangzhou Automobile Group	6.826	_
188.443	HKD	Hope Education Group	28.080	0,01
657	HKD	Hutchmed China	4.811	_
2.460	USD	Hutchmed China-ADR	90.061	0,02
400	CNH	Midea Group	4.318	_
81.600	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	145.912	0,04
30.500	HKD	Venus MedTech Hangzhou	157.502	0,04
9.428	CNH	Venustech Group	40.371	0,01
4.000	CNH	Will Semiconductor		•
14.399	HKD	Shanghai WuXi AppTec	150.504 336.824	0,04 0,08
438	HKD	XPeng	7.596	0,00
6.083	USD	Xpeng-ADR	216.190	0.05
600	HKD	Zai Lab		0,05
6.113	USD	Zai Lab Zai Lab-ADR	64.666 644.248	0,02 0,16
4.595	CNH	Zhejiang HangKe	U44.Z4ŏ	0,10
		Technology	58.970	0,01



Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Tschechisc			84.612	0,02
2.088	CZK	Komercni banka	84.612	0,02
Dänemark	LICD		1.637.365	0,40
6.444	USD	Ascendis Pharma	1.027.110	0,25
264 35.464	DKK	Genmab	115.510	0,03
2.047	DKK DKK	Spar Nord Bank	412.642	0,10
	DKK	Vestas Wind Systems	82.103	0,02
Finnland	CEL		355.860	0,09
27.545	SEK	Nordea Bank Abp	355.860	0,09
Frankreich	FUD		6.220.515	1,51
50.704	EUR	ALD	693.049	0,17
32.553	EUR	AXA	908.192	0,22
4.329	EUR	Cie de Saint-Gobain	292.044	0,07
51.766	EUR	Credit Agricole	716.320	0,17
3.888	USD	Criteo	142.495	0,03
87.490	EUR	Engie	1.149.444	0,28
3.202	EUR	Legrand	344.050	0,08
3.952	EUR	Rothschild	171.210	0,04
1.639	EUR	Safran	208.193	0,05
7.567	EUR	TotalEnergies	362.311	0,09
7.761	EUR	Vallourec	67.874	0,02
11.652	EUR	Veolia Environnement	357.133	0,09
5.817	EUR	Veolia Environnement- Rights	4.838	-
770	EUR	Vinci	80.407	0,02
9.455	EUR	Worldline	722.955	0,18
Deutschlan	ıd		3.652.673	0,89
570	EUR	Brenntag	53.204	0,01
120.731	EUR	Commerzbank	804.830	0,20
15.338	EUR	Deutsche Bank	196.110	0,05
890	EUR	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft	244.228	0,06
612	EUR	RWE	21.657	0,01
6.357	EUR	Siemens	1.045.046	0,25
12.026	EUR	Talanx	513.750	0,12
35.327	EUR	TUI	153.863	0,04
882	EUR	Volkswagen	197.835	0,05
2.258	EUR	Wacker Chemie	422.150	0,10
Hongkong			1.029.378	0,25
52.347	HKD	AIA Group	604.859	0,15
522	HKD	ASM Pacific Technology	5.777	-,
6.794	HKD	Hong Kong Exchanges & Clearing	418.742	0,10
			· -	

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Ungarn			641.140	0,16
10.930	HUF	OTP Bank	641.140	0,16
Indien			3.817.393	0,93
141.559	INR	Coal India	352.241	0,09
3.183	INR	Hindustan Petroleum	12.865	_
20.335	INR	Kotak Mahindra Bank	547.910	0,13
23.916	INR	Mahindra & Mahindra	259.370	0,06
187.714	INR	NTPC	358.598	0,09
4.508	INR	Oil & Natural Gas	8.745	_
240.097	INR	Power Grid of India	612.473	0,15
49.205	INR	Reliance Industries	1.665.191	0,41
Indonesier	า		217.073	0,05
11.364.300	IDR	Panin Financial	142.922	0,03
1.538.100	IDR	Paninvest	74.151	0,02
Irland			1.750.847	0,43
11.291	USD	AerCap Holdings	652.733	0,16
298.744	EUR	AIB Group	812.872	0,20
342	GBP	Flutter Entertainment	67.647	0,02
43.534	EUR	Irish Continental Group	217.595	0,05
Israel			246.346	0,06
8.239	USD	Tower Semiconductor	246.346	0,06
Italien			2.748.322	0,67
12.159	EUR	Banca Generali	533.798	0,13
1.746	EUR	DiaSorin	366.777	0,09
22.748	EUR	Enel	175.255	0,04
263.758	EUR	Intesa Sanpaolo	749.603	0,18
31.683	EUR	Poste Italiane	437.831	0,11
36.413	EUR	UniCredit	485.058	0,12
Japan			3.889.620	0,94
31.243	JPY	Astellas Pharma	517.231	0,13
11.900	JPY	Daiichi Sankyo	318.577	0,08
84	JPY	Daiwa Securities Living Investments	84.381	0,02
4.090	JPY	East Japan Railway	288.187	0,07
2.746	JPY	Hitachi	163.830	0,04
13.800	JPY	Japan Steel Works	361.693	0,09
310	JPY	JFE Holdings	4.727	-
5.000	JPY	Kubota	107.327	0,03
53 98.714	JPY JPY	Kureha Mitsubishi UFJ Financial	3.624	-
	-	Group	583.529	0,13
100	JPY	Mitsui Mining & Smelting	2.817	_
200	JPY	Nippon Steel	3.655	-

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

% des Netto- vermö- gens
0,10
-
0,08
0,10
0,07
-
-
0,05
0,05
0,23
0,17
0,04
0,02
0,65
0,11
0,04
0,04
0,07
0,19
_
0,20
_
0,19
0,05
0,13
0,01
0,04
0,04
0,35
0,35
0,06
0,06
0,22
0,15
0,05
0,02
0,29
0,12
-
0,03
0,09
0,05
-

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Spanien			1.840.326	0,45
2.285	USD	Atlantica Sustainable Infrastructure	78.855	0,02
101.427	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	671.679	0,17
32.911	EUR	CaixaBank	102.321	0,02
3.800	EUR	Cellnex Telecom	234.612	0,06
5.039	EUR	Endesa	101.679	0,02
26.668	EUR	Grifols	651.180	0,16
Schweden			2.077.308	0,50
12.645	SEK	Alfa Laval	474.636	0,11
5.766	SEK	Boliden	185.934	0,05
17.426	SEK	Hexagon	270.614	0,07
5.546	SEK	Lundin Energy	207.031	0,05
12.349	SEK	Sandvik	283.814	0,07
27.394	SEK	Svenska Handelsbanken	307.660	0,07
15.443	SEK	Volvo	347.619	0,08
Schweiz			748.061	0,18
5.616	CHF	Alcon	458.223	0,11
3.601	EUR	STMicroelectronics	157.526	0,04
232	CHF	Tecan Group	132.312	0,03
Taiwan		·	284.078	0,07
9.447	TWD	Accton Technology	89.179	0,02
6.000	TWD	MediaTek	194.899	0,05
Thailand			291.936	0,07
40.797	THB	Kasikornbank	160.969	0,04
33.193	THB	Kasikornbank-NVDR	130.967	0,03
Vereinigtes	Königreic	h	6.495.916	1,58
6.285	GBP	Abcam	126.857	0,03
76.573	GBP	AJ Bell	411.666	0,10
46.932	EUR	Allfunds Group	912.222	0,21
2.082	GBP	AstraZeneca	251.298	0,06
114.945	GBP	Babcock International Group	575.832	0,14
293.726	GBP	Barclays	750.372	0,18
94.937	GBP	Beazley	485.065	0,12
103.152	GBP	HSBC Holdings	542.119	0,13
6.774	GBP	Intermediate Capital Group	186.653	0,05
33.535	GBP	National Express Group	108.986	0,03
30.136	GBP	National Grid	359.194	0,09
2.600	GBP	Oxford Nanopore Technologies	21.461	0,01
7.266	GBP	Persimmon	261.203	0,06
25.373	GBP	Prudential	497.429	0,12
28.945	GBP	Rotork	136.034	0,03
237.443	GBP	Serco Group	428.707	0,10
		•		



Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
3.759	GBP	Smith & Nephew	65.185	0,02	3.280	USD	BWX Technologies	176.661	0,04
26.388	GBP	Standard Chartered	155.021	0,04	10.072	USD	Cactus	379.916	0,09
8.784	NOK	Subsea 7	76.448	0,02	20.932	USD	Capstar Financial Holdings	444.596	0,11
12.969	GBP	Workspace Group	144.164	0,04	3.214	USD	Cardlytics	269.783	0,07
Vereinigte			83.884.944	20,38	41.600	USD	CareMax	394.149	0,10
2.992	USD	Acceleron Pharma	514.923	0,13	1.584	USD	Cavco Industries	374.996	0,09
1.106	USD	Accenture	353.832	0,09	1.948	USD	CBTX	51.388	0,01
24.026	USD	Aclaris Therapeutics	432.468	0,11	4.105	USD	Celldex Therapeutics	221.629	0,05
8.241	USD	AdaptHealth	191.933	0,05	6.623	USD	Centene	412.679	0,10
7.612	USD	agilon health	199.511	0,05	19.159	USD	CenterPoint Energy	471.311	0,11
5.787	USD	Airbnb	970.769	0,24	9.291	USD	Century Aluminum	124.964	0,03
173	USD	Albemarle	37.882	0,01	3.151	USD	Chegg	214.331	0,05
2.600	USD	Alcoa	127.244	0,03	12.731	USD	Cheniere Energy	1.243.437	0,30
1.316	USD	Align Technology	875.706	0,21	32.591	USD	Chesapeake Energy	2.007.280	0,49
24.134	USD	Aligos Therapeutics	374.318	0,09	5.610	USD	Chubb	973.223	0,24
784	USD	Alnylam Pharmaceuticals	148.027	0,04	44.045	USD	Cimarex Energy	3.840.723	0,93
2.200	USD	Altra Industrial Motion	121.770	0,03	2.316	USD	Clean Harbors	240.563	0,06
8.934	USD	ALX Oncology Holdings	659.865	0,16	28.692	USD	Clearwater Analytics	240.505	0,00
17.010	USD	Amerant Bancorporation	420.827	0,10	20.032	030	Holdings	734.802	0,18
8.862	USD	American Electric Power	719.417	0,17	3.615	USD	ConocoPhillips	244.989	0,06
8.976	USD	American Express	1.503.749	0,37	3.524	USD	Consolidated Edison	255.807	0,06
5.218	USD	American Homes 4 Rent	198.910	0,05	1.542	USD	Constellation Brands	324.884	0,08
8.050	USD	Ameris Bancorporation	417.634	0,10	3.563	USD	Copart	494.259	0,12
61.099	USD	Amicus Therapeutics	583.495	0,14	1.040	USD	CoStar Group	89.502	0,02
29.613	USD	Antero Resources	557.021	0,14	1.649	USD	Danaher	502.022	0,12
3.483	USD	Apellis Pharmaceuticals	114.800	0,03	608	USD	Deere	203.723	0,05
3.500	USD	Applied Industrial Technologies	315.455	0,08	280	USD	Denbury	19.670	-
4.113	USD	Apria	152.798	0,04	9.603	USD	DHT Holdings	62.708	0,02
1.140	USD	Aptiv	169.826	0,04	14.101	USD	Diamondback Energy	1.334.942	0,32
11.780	USD	Arch Capital Group	449.760	0,11	14.466	USD	Dyne Therapeutics	234.928	0,06
1.561	USD	Archaea Energy	29.565	0,01	1.396	USD	Eaton	208.437	0,05
273	USD	Arena Pharmaceuticals	16.257	_	1.710	USD	Edison International	94.854	0,02
28.307	USD	Ares Management	2.089.905	0,51	3.666	USD	Elanco Animal Health	116.909	0,03
472	USD	Arista Networks	162.198	0,04	32.578	USD	EnLink Midstream LLC	222.182	0,05
1.260	USD	Aspen Technology	154.728	0,04	2.997	USD	Enstar Group	703.486	0,17
2.428	USD	Assurant	383.017	0,09	6.630	USD	EOG Resources	532.190	0,13
6.292	USD	Avangrid	305.791	0,07	1.337	USD	Equifax	338.823	0,08
12.365	USD	Baker Hughes	305.786	0,07	27.488	USD	Equitable Holdings	814.744	0,20
6.884	USD	Bank of New York Mellon	356.867	0,09	6.108	USD	Evans Bancorporation	233.936	0,06
65	USD	BioAtla	1.914	_	7.900	USD	EVgo	62.745	0,02
8.331	USD	Blueprint Medicines	856.510	0,21	7.751	USD	Exact Sciences	739.833	0,18
10.532	USD	Bluescape Opportunities		-,	22.232	USD	Exelon	1.074.695	0,26
		Acquisition	103.214	0,03	1.037	USD	Facebook	351.947	0,09
41	USD	Booking Holdings	97.329	0,02	1.687	GBP	Ferguson	234.921	0,06
20.421	USD	Brigham Minerals	391.266	0,10	571	USD	Fidelity National Information Services	69.479	0,02
9.964 40.200	USD USD	Builders FirstSource Butterfly Network	515.537 419.688	0,13 0,10	6.509	USD	First Community	129.855	0,02
10.200	000	zatterny retwork	+15.000	0,10					

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
4.509	USD	First Solar	430.429	0,10	5.532	USD	Magellan Midstream	252.442	
14.136	USD	FirstEnergy	503.524	0,12	F 440	LICE	Partners	252.149	0,06
981	USD	Five Below	173.451	0,04	5.419	USD	Magnolia Oil & Gas	96.404	0,02
2.421	USD	FleetCor Technologies	632.535	0,15	10.450	USD	Marvell Technology	630.240	0,15
2.101	USD	Floor & Decor Holdings	253.780	0,06	283	USD	Mastercard	98.393	0,02
44.889	USD	Fluor	716.877	0,17	518	USD	Match Group	81.321	0,02
1.032	USD	Fluor-Preference perpetual	1.034.414	0,25	7.661	USD	Maxeon Solar Technologies	135.063	0,03
7.571	USD	Flushing Financial	171.105	0,04	23.386	USD	Medical Properties Trust	469.357	0,11
33.624	USD	Ford Motor	476.116	0,12	27.781	USD	Metals Acquisition	277.810	0,07
30.772	USD	Fortistar Sustainable Solutions	300.642	0,07	12.864	USD	MetLife	794.095	0,19
1.993	USD	Glaukos	96.003	0,02	58.746	USD	MGIC Investment	878.840	0,21
2.082	USD	Haemonetics	146.968	0,04	707	USD	Middleby	120.551	0,03
48.110	USD	Hamilton Lane Alliance			2.347	USD	Mirati Therapeutics	415.208	0,10
		Holdings I	481.100	0,12	15.057	USD	Morgan Stanley	1.465.197	0,36
4.794	USD	Hannon Armstrong Sustainable			15.727	USD	MVB Financial	673.587	0,16
		Infrastructure Capital	256.383	0,06	11.219	USD	Myovant Sciences	251.754	0,06
125	USD	Humana	48.644	0,01	499	USD	NanoString	2011/01	0,00
854	USD	IDEXX Laboratories	531.103	0,13			Technologies	23.957	0,01
10.082	USD	IHS Markit	1.175.763	0,29	15.666	USD	Navigator Holdings	139.427	0,03
6.905	USD	II-VI	409.881	0,10	9.127	USD	New Jersey Resources	317.711	0,08
66.889	USD	ImmunoGen	379.261	0,09	8.491	USD	Noble	229.766	0,06
3.355	USD	Integra LifeSciences	000 750	0.05	8.023	USD	Northeast Bank	270.536	0,07
F26	LICE	Holdings	229.750	0,06	9.396	USD	Nurix Therapeutics	281.504	0,07
536	USD	International Bancshares	22.319	0,01	1.358	USD	Oak Street Health	57.756	0,01
8.920	USD	Invitae	253.596	0,06	94	USD	Oasis Petroleum	9.345	_
6.350	USD	Invitation Homes	243.396	0,06	17.116	USD	Olema Pharmaceuticals	471.717	0,11
3.786	USD	iRhythm Technologies	221.708	0,05	7.121	USD	Oscar Health	123.834	0,03
16.963	USD	Ironwood Pharmaceuticals	221.537	0,05	21.501	USD	Ovintiv	706.953	0,17
10.777	USD	Jackson Financial	280.202	0,07	5.836	USD	Owens & Minor	182.608	0,04
300	USD	Johnson & Johnson	48.450	0,01	32.645	USD	Payoneer Global	279.115	0,07
13.206	USD	Johnson Controls			1.378	USD	PayPal Holdings	358.569	0,09
		International	899.064	0,22	4.759	USD	PDC Energy	225.529	0,05
669	USD	JPMorgan Chase	109.509	0,03	42.777	USD	Perella Weinberg		•
2.334	USD	Karuna Therapeutics	285.518	0,07			Partners	566.795	0,14
9.858 4.915	USD USD	Kinder Morgan Knight-Swift	164.924	0,04	1.436	USD	Phillips 66	100.563	0,02
4.915		Transportation Holdings	251.402	0,06	6.864	USD	Pioneer Natural Resources	1.142.925	0,28
5.342	USD	Kodiak Sciences	512.725	0,12	29.151	USD	Plains GP Holdings	314.102	0,08
6.772	USD	Kymera Therapeutics	397.787	0,10	3.815	USD	Planet Fitness	299.668	0,07
1.086	USD	Laredo Petroleum	88.042	0,02	8.224	USD	PNC Financial Services		5,57
6.349	USD	Lennar	594.774	0,14			Group	1.608.943	0,39
2.626	USD	Livent	60.687	0,01	12.170	USD	Pontem	118.171	0,03
1.987	USD	Madrigal Pharmaceuticals	158.543	0,04	5.033	USD	Portland General Electric	236.501	0,06
			.50.575	0,04	1.275	USD	Prologis	159.923	0,04



Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
272	USD	Proterra	2.750	_	11.486	USD	Valaris	400.632	0,10
1.942	USD	Quidel	274.113	0,07	5.730	USD	Valero Energy	404.366	0,10
252	USD	Rapid7	28.481	0,01	3.713	USD	Varonis Systems	225.936	0,05
8.897	USD	Rattler Midstream	104.451	0,03	2.675	USD	Veracyte	124.254	0,03
6.240	USD	RBC Bearings	695.573	0,17	2.207	USD	Verisk Analytics	441.996	0,11
1.247	USD	Reata Pharmaceuticals	125.461	0,03	7.691	USD	Veritex Holdings	302.718	0,07
10.934	USD	Repay Holdings	251.810	0,06	5.927	USD	Verve Therapeutics	278.569	0,07
3.472	USD	Rhythm Pharmaceuticals	45.344	0,01	37.567	USD	Vine Energy	618.728	0,15
29.062	USD	Ribbit LEAP	294.107	0,07	594	USD	Viper Energy Partners	12.979	_
8.096	USD	Rice Acquisition II	83.389	0,02	11.246	USD	Western Alliance		
582	USD	S&P Global	247.286	0,06			Bancorporation	1.223.790	0,30
2.752	USD	Sage Therapeutics	121.941	0,03	13.839	USD	Western Midstream Partners	290.065	0,07
639	USD	Salesforce.com	173.310	0,04	5.315	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	458.206	0,11
3.489	EUR	Schneider Electric	581.569	0,14	20.166	USD	Whiting Petroleum	1.177.896	0,29
2.980	USD	Seagen	506.004	0,12	6.132	USD	Zions Bancorporation	379.509	0,09
4.898	USD	Sempra Energy	619.597	0,15	Vietnam		<u> </u>	286.006	0,07
2.459	USD	Shoals Technologies Group	68.557	0,02	131.240	VND	Vietnam Technological &		
1.494	USD	Simon Property Group	194.175	0,05			Commercial Joint Stock Bank	286.006	0,07
8.854	USD	Skyline Champion	531.771	0,13	C	tion.			-
				0,.5	Summe Ak	tien		154.928.656	37,64
7.281	USD	SM Energy	192.073	0,05	Anleihen	tien		154.928.656	37,64
7.281 153	USD USD	SM Energy SoFi Technologies			Anleihen	tien			
		-	192.073			USD	Angolan Government	414.112	0,10
153	USD	SoFi Technologies	192.073 2.430	0,05 -	Anleihen Angola		International Bond	414.112	0,10
153 688	USD USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies	192.073 2.430 182.471	0,05 - 0,04	Anleihen Angola 400.000	USD	3	414.112 414.112	0,10
153 688 8.466	USD USD USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries	192.073 2.430 182.471 179.987	0,05 - 0,04 0,04	Anleihen Angola 400.000 Argentinie	USD	International Bond 08/05/48, 9.38%	414.112	0,10
153 688 8.466 408	USD USD USD USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855	0,05 - 0,04 0,04 0,02	Anleihen Angola 400.000	USD	International Bond	414.112 414.112	0,10
153 688 8.466 408 3.985	USD USD USD USD USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609	0,05 - 0,04 0,04 0,02 0,08	Anleihen Angola 400.000 Argentinie	USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic	414.112 414.112	0,10
153 688 8.466 408 3.985 2.076	USD USD USD USD USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483	0,05 - 0,04 0,04 0,02 0,08 0,13	Anleihen Angola 400.000 Argentinie	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government	414.112 414.112 2.493.435	0,10 0,10 0,61
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604	USD USD USD USD USD USD USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377	0,05 - 0,04 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475	USD n USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond	414.112 414.112 2.493.435 92.946	0,10 0,10 0,61
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604	USD USD USD USD USD USD USD USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377	0,05 - 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475	USD n USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government	414.112 414.112 2.493.435	0,10 0,10 0,61
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377 73.229 139.135 55.357	0,05 - 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475 1.083.761	USD N USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government Government International Bond 09/07/30, 0.50%	414.112 414.112 2.493.435 92.946	0,10 0,10 0,61
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377 73.229 139.135	0,05 - 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475 1.083.761	USD N USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Republic Republic Republic Republic	414.112 414.112 2.493.435 92.946	0,10 0,10 0,61
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618 308 30.767	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics Synovus Financial	192.073	0,05 - 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33 0,11	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475 1.083.761	USD N USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government International Bond 109/07/30, 0.50%	414.112 414.112 2.493.435 92.946 398.391	0,10 0,10 0,61 0,02
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618 308 30.767 8.895	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics Synovus Financial Targa Resources	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377 73.229 139.135 55.357 1.350.364 437.723 44.524	0,05 - 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33 0,11 0,01	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475 1.083.761 4.354.510	USD N USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13%	414.112 414.112 2.493.435 92.946 398.391	0,10 0,10 0,61 0,02
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618 308 30.767 8.895 5.232	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics Synovus Financial Targa Resources TCR2 Therapeutics	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377 73.229 139.135 55.357 1.350.364 437.723 44.524 405.168	0,05 - 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33 0,11 0,01 0,01	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475 1.083.761 4.354.510	USD N USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic	414.112 414.112 2.493.435 92.946 398.391	0,10 0,10 0,61 0,02
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618 308 30.767 8.895 5.232 1.076	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics Synovus Financial Targa Resources TCR2 Therapeutics Teleflex	192.073	0,05 - 0,04 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33 0,11 0,01 0,01 0,05	Anleihen Angola 400.000 Argentinies 241.475 1.083.761 4.354.510	USD N USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50% Cia Latinoamericana de	414.112 414.112 2.493.435 92.946 398.391 1.426.145	0,10 0,10 0,61 0,02 0,10
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618 308 30.767 8.895 5.232 1.076 2.255	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics Synovus Financial Targa Resources TCR2 Therapeutics Teleflex Trimble	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377 73.229 139.135 55.357 1.350.364 437.723 44.524 405.168	0,05 - 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33 0,11 0,01 0,01	Anleihen Angola 400.000 Argentinie 241.475 1.083.761 4.354.510 285.000	USD USD USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50% Cia Latinoamericana de Infraestructura &	414.112 414.112 2.493.435 92.946 398.391 1.426.145	0,10 0,10 0,61 0,02 0,10 0,34
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618 308 30.767 8.895 5.232 1.076 2.255 3.511 14.641	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics Synovus Financial Targa Resources TCR2 Therapeutics Teleflex Trimble Triumph Bancorporation United Community Banks	192.073	0,05 - 0,04 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33 0,11 0,01 0,01 0,05	Anleihen Angola 400.000 Argentinie 241.475 1.083.761 4.354.510 285.000	USD USD USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50% Cia Latinoamericana de	414.112 414.112 2.493.435 92.946 398.391 1.426.145	0,10 0,10 0,61 0,02 0,10
153 688 8.466 408 3.985 2.076 7.604 7.503 1.618 308 30.767 8.895 5.232 1.076 2.255 3.511	USD	SoFi Technologies SolarEdge Technologies South Jersey Industries Square State Street Stryker Sunlight Financial Holdings Sustainable Development Acquisition I Swiss Re Synaptics Synovus Financial Targa Resources TCR2 Therapeutics Teleflex Trimble Triumph Bancorporation United Community	192.073 2.430 182.471 179.987 97.855 337.609 547.483 40.377 73.229 139.135 55.357 1.350.364 437.723 44.524 405.168 185.474 351.556	0,05 - 0,04 0,04 0,02 0,08 0,13 0,01 0,02 0,03 0,01 0,33 0,11 0,01 0,05 0,09	Anleihen Angola 400.000 Argentinie 241.475 1.083.761 4.354.510 285.000	USD USD USD USD	International Bond 08/05/48, 9.38% Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00% Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13% Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50% Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 25/07/27, 5.25%	414.112 414.112 2.493.435 92.946 398.391 1.426.145	0,10 0,10 0,61 0,02 0,10 0,34

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Österreich			600.040	0,15
600.000	USD	Oesterreichische Kontrollbank 22/11/21, variabel	600.040	0,15
Aserbaidsc	han		525.447	0,13
445.000	USD	Southern Gas Corridor 24/03/26, 6.88%	525.447	0,13
Benin			347.835	0,08
100.000	EUR	Benin Government International Bond 19/01/32, 4.88%	115.864	0,03
205.000	EUR	Benin Government International Bond 22/01/35, 4.95%	231.971	0,05
Kanada			317.755	0,08
400.000	CAD	Province of British Columbia Canada 18/12/21, 3.25%	317.755	0,08
China			1.102.390	0,27
200.000	USD	Bank of China 20/11/21, variabel	200.108	0,05
500.000	USD	Bank of China 16/01/22, variabel	500.367	0,12
200.000	USD	Bank of China 17/04/22, variabel	200.265	0,05
200.000	USD	Industrial & Commercial Bank of China 21/02/22, 2.88%	201.650	0,05
Kolumbien			1.123.359	0,27
330.000	USD	Bancolombia 18/12/29, variabel	334.698	0,08
460.000	USD	Colombia Government International Bond 30/01/30, 3.00%	433.787	0,10
380.000	USD	Colombia Government International Bond 22/04/32, 3.25%	354.874	0,09
Kroatien			944.114	0,23
440.000	EUR	Croatia Government International Bond 17/06/31, 1.50%	534.087	0,13
345.000	EUR	Croatia Government International Bond 04/03/41, 1.75%	410.027	0,10
Dominikan	ische Repu	ıblik	602.966	0,15
260.000	USD	Dominican Republic International Bond 23/09/32, 4.88%	265.853	0,06
340.000	USD	Dominican Republic International Bond 21/01/41, 5.30%	337.113	0,09

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Ägypten			1.225.251	0,30
9.035.000	EGP	Egypt Government Bond 06/07/26, 14.56%	580.418	0,14
230.000	USD	Egypt Government International Bond 16/02/26, 3.88%	216.790	0,05
230.000	USD	Egypt Government International Bond 29/05/37, 7.63%	229.960	0,06
225.000	USD	Egypt Government International Bond 16/02/61, 7.50%	198.083	0,05
Äthiopien			226.319	0,05
260.000	USD	Ethiopia International Bond 11/12/24, 6.63%	226.319	0,05
Frankreich			700.045	0,17
600.000	EUR	Mutuelle Assurance Des Commercants et Industriels de France et Des Cadres et Sal	700.045	
		perpetual, variabel	700.045	0,17
Deutschlar		D 45 (07 (05 5 75))	811.123	0,20
135.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	162.945	0,04
400.000	EUR	Vonovia Finance 28/01/41, 1.00%	418.747	0,10
200.000	EUR	Wintershall DeaFinance 2 Series NC8 perpetual, variabel	229.431	0,06
Ghana			199.340	0,05
205.000	USD	Kosmos Energy 01/03/28, 7.50%	199.340	0,05
Honduras			156.752	0,04
150.000	USD	Honduras Government International Bond 24/06/30, 5.63%	156.752	0,04
Ungarn			1.015.235	0,25
275.000	EUR	Hungary Government International Bond 28/04/32, 1.63%	336.544	0,08
395.000	EUR	Hungary Government International Bond 05/06/35, 1.75%	481.340	0,12
200.000	USD	Hungary Government International Bond 21/09/51, 3.13%	197.351	0,05
Elfenbeink	üste		498.665	0,12
100.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	113.125	0,03
330.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 22/03/48, 6.63%	385.540	0,09



Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Luxemburg	g		659.716	0,16	Russland			2.466.182	0,60
590.000	EUR	Altice Financing 15/01/25, 2.25%	659.716	0,16	173.780.000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 23/03/33, 7.70%	2.466.182	0,60
Mexiko			819.849	0,20	Senegal			690.477	0,17
500.000	EUR USD	America Movil 02/03/24, ZCP Petroleos Mexicanos	601.424	0,15	225.000	EUR	Senegal Government International Bond 13/03/28, 4.75%	271.827	0,07
230.000	030	21/09/47, 6.75%	218.425	0,05	365.000	EUR	Senegal Government		
Marokko			199.891	0,05			International Bond 08/06/37, 5.38%	418.650	0,10
200.000	USD	OCP 23/06/31, 3.75%	199.891	0,05	Serbien		00/00/37/3.50/0	458.762	0,11
Niederland	le		1.731.167	0,42	360.000	EUR	Serbia International	150.702	0,
1.120.000	EUR	Aegon perpetual, variabel	1.168.136	0,28			Bond 15/05/27, 3.13%	458.762	0,11
555.000	USD	VEON Holdings 25/11/27, 3.38%	563.031	0,14	Südafrika 12.895.000	740	Republic of South Africa	5.746.404	1,39
Nordmaze	donien	·	542.014	0,13	12.093.000	ZAN	Government Bond		
270.000	EUR	North Macedonia Government International Bond 03/06/26, 3.68%	343.613	0,08	23.980.000	ZAR	28/02/31, 7.00% Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	720.887 1.425.361	0,18
175.000	EUR	North Macedonia Government International Bond		·	41.435.000		Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	2.444.798	0,58
•		10/03/28, 1.63%	198.401	0,05	25.130.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond		
Oman 200.000	LICD	Oman Cayaramant	198.547	0,05			31/03/36, 6.25%	1.155.358	0,28
200.000	USD	Oman Government International Bond			Südkorea			1.306.459	0,32
		17/01/48, 6.75%	198.547	0,05	400.000	USD	Export-Import Bank of Korea 05/07/22, variabel	402.022	0,10
Rumänien			2.263.571	0,55	200.000	USD	Korea Development	402.033	0,10
130.000	EUR	Romanian Government International Bond 02/12/29, 1.38%	148.179	0,04	500.000	USD	Bank 27/02/22, variabel Korea Development	200.468	0,05
150.000	EUR	Romanian Government International Bond	110,175	3,0 .	200.000	USD	Bank 30/10/22, variabel Korea Development	503.496	0,12
		13/07/30, 1.75%	170.203	0,04			Bank 18/02/23, variabel	200.462	0,05
335.000	EUR	Romanian Government			Spanien			1.772.991	0,43
147.000	EUR	International Bond 16/07/31, 2.12% Romanian Government	388.067	0,09	1.370.000	EUR	Cirsa Finance International Sarl 15/03/27, 4.50%	1.573.018	0,38
		International Bond 14/04/33, 2.00%	162.794	0,04	200.000	USD	Instituto de Credito Oficial 15/12/21, variabel	199.973	0,05
65.000	EUR	Romanian Government International Bond			Supranatio	nal	-	6.927.485	1,67
250.000	EUR	08/02/38, 3.38% Romanian Government	78.359	0,02	127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.497.445	0,36
135.000	EUR	International Bond 02/12/40, 2.63% Romanian Government	270.409	0,07	16.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	785.608	0,19
745 000	ELID	International Bond 14/04/41, 2.75%	145.647	0,04	2.020.000	EUR	European Union 04/07/41, 0.45%	2.318.744	0,55
745.000	EUR	Romanian Government International Bond 13/04/42, 2.88%	808.517	0,19	575.000	EUR	European Union 06/07/51, 0.70%	685.850	0,17
80.000	EUR	Romanian Government International Bond 28/01/50, 3.38%	91.396	0,02					

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	
11.750.000	MXN	International Bank for Reconstruction &			Aktien				
		Development			Vereinigte			666.910	0,16
		25/05/33, ZCP	232.325	0,06	36.900	USD	Archaea Energy	666.910	0,16
7.200.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	325.704	0,08	Summe Ak	tien		666.910	0,16
55.300.000	MXN	International Finance	323.701	0,00	Anleihen				
		29/01/36, ZCP	859.901	0,21	Aserbaidsc	han		153.318	0,04
16.400.000	MXN	International Finance 22/02/38, ZCP	221.908	0,05	150.000	USD	Republic of Azerbaijan International Bond	452.240	0.04
Schweiz			654.106	0,16	B 200		01/09/32, 3.50%	153.318	0,04
665.000	USD	Julius Baer Group perpetual, variabel	654.106	0,16	Brasilien 200.000	USD	Centrais Eletricas	199.250	0,05
Türkei			207.916	0,05			Brasileiras 04/02/25, 3.63%	199.250	0,05
250.000	USD	Turkey Government			Kanada			5.056.753	1,23
		International Bond 11/05/47, 5.75%	207.916	0,05	250.000	CAD	Alberta Treasury Bill		
Ukraine			736.547	0,18			12/10/21, ZCP	197.367	0,05
200.000	USD	Ukraine Government			200.000	CAD	Alberta Treasury Bill 12/04/22. ZCP	157.703	0,04
		International Bond 21/05/29, 6.88%	203.267	0,05	200.000	CAD	Canadian Treasury Bill 14/10/21, ZCP	157.894	0,04
525.000	USD	Ukraine Government International Bond 15/03/33, 7.25%	533.280	0,13	500.000	CAD	CDP Financial 03/11/21, ZCP	394.690	0,09
Vereinigtes	Köniarei	<u> </u>	5.095.449	1,23	900.000	CAD	City of Montreal Canada		
1.715.000	EUR	British American	3.033.113	1,23	250,000	CAD	01/12/21, 4.50%	715.339	0,16
		Tobacco perpetual, variabel	1.976.637	0,47	250.000 346.000	CAD	City of Montreal Canada 11/05/22, 0.25% City of Quebec Canada	197.271	0,05
1.030.000	GBP	CPUK Finance 28/08/27, 4.50%	1.415.881	0,34	200.000	CAD	05/03/22, 1.65% City of Toronto Canada	274.656	0,07
200.000	GBP	Deuce Finco 15/06/27, 5.50%	273.244	0,07	960.000	CAD	06/12/21, 3.50% City of Vancouver	158.786	0,04
290.000	GBP	Heathrow Funding	201.040	0.10	300.000	CAD	02/12/21, 3.45%	761.778	0,18
765.000	GBP	16/03/28, 2.63% Wheel Bidco 15/07/26, 6.75%	391.840 1.037.847	0,10	200.000	CAD	Hydro Quebec Interest Strip 16/01/22, ZCP	157.762	0,04
Vereinigte	Staaton	13/0/120, 0.73%		0,25	275.000	CAD	Municipal Finance		
580.000	EUR	Becton Dickinson Euro	1.299.420	0,32			Authority of British Columbia Bills		
380.000	LOK	Finance Sarl 13/08/41, 1.34%	646.275	0,16	345.000	CAD	20/10/21, ZCP Municipal Finance	217.095	0,05
650.000	USD	United States Treasury Note/Bond					Authority of British Columbia Bills 03/11/21, ZCP	272.337	0,07
		31/12/21, 2.00%	653.145	0,16	35.000	CAD	Municipal Finance	2,2,50,	0,07
Venezuela 360.000	USD	Venezuela Government	39.240	0,01			Authority of British Columbia Bills		
360.000	מצט	International Bond 07/05/28, 9.25%*	39.240	0,01	200.000	CAD	17/11/21, ZCP Newfoundland Treasury	27.627	0,01
Summe An	leihen		47.120.376	11,45	200.000	CAD	Bill 07/10/21, ZCP	157.898	0,04
Summe üb	ertragbar	e Wertpapiere und nte, die zu einer amtlichen		,	300.000	CAD	Nova Scotia Treasury Bill 05/10/21, ZCP	236.850	0,06
		gelassen sind	202.049.032	49,09	400.000	CAD	Ontario Treasury Bill 26/01/22, ZCP	315.593	0,08

^{*} Notleidendes Wertpapier.



Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
300.000	CAD	OPB Finance Trust			Südkorea			399.982	0,10
100.000	CAD	24/02/22, 1.88% Province of British	238.329	0,06	400.000	USD	Korea Development Bank 07/11/21, variabel	399.982	0,10
100.000	CAD	Columbia 28/01/22, ZCP	78.898	0,02	Taiwan	,		1.936.368	0,47
180.000	CAD	Province of British Columbia 26/04/22, ZCP	141.927	0,03	1.904.000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	1.936.368	0,47
250.000	CAD	Province of British			Vereinigtes	s Königreic	:h	665.060	0,16
		Columbia Canada Principal Strip 23/02/22, ZCP	196.953	0,05	645.000	USD	Vodafone Group 04/06/81, variabel	665.060	0,16
China			1.172.634	0,28	Vereinigte	Staaten		83.462.114	20,27
250.000	USD	CNPC Finance			240.000	USD	Adams Homes	050.000	
2001000	002	05/10/21, ZCP	249.993	0,06	005 000	LICD	15/02/25, 7.50%	250.962	0,06
550.000	USD	CNPC Finance	549.972	0,13	985.000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	970.225	0,24
455.000	LICE	07/10/21, ZCP			1.238.000	USD	Avalara 01/08/26, 0.25%	1.277.084	0,31
455.000	USD	NIO 01/02/27, 0.50%	372.669	0,09	1.760.000	USD	Community Health Systems 15/02/31, 4.75%	1.773.639	0,43
Ägypten			809.755	0,20	790.000	USD	Cornerstone Building	1.773.033	0,15
12.775.000	EGP	Egypt Treasury Bill 12/10/21, ZCP	809.755	0,20			Brands 15/01/29, 6.13%	840.363	0,20
Japan			14.873.774	3,61	465.000	USD	Cracker Barrel Old Country Store		
59.300.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 04/10/21, ZCP	532.823	0,13	890.000	USD	15/06/26, 0.63% DISH DBS	471.103	0,11
26.050.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/10/21, ZCP	234.069	0,06	590.000	USD	01/07/28, 7.38%	948.918	0,23
193.400.000) IPY	Japan Treasury Discount	20003	0,00			Etsy 15/06/28, 0.25%	672.305	0,16
		Bill 18/10/21, ZCP	1.737.811	0,42	650.000	USD	IMAX 01/04/26, 0.50%	638.173	0,16
65.400.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 25/10/21, ZCP	587.670	0,14	780.000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	768.178	0,19
55.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 08/11/21, ZCP	494.239	0,12	1.369.000	USD	John Bean Technologies 15/05/26, 0.25%	1.454.562	0,35
165.000.000) JPY	Japan Treasury Discount Bill 15/11/21, ZCP	1.482.752	0,36	30.000	USD	Rockcliff Energy II LLC 15/10/29, 5.50%	30.488	0,01
15.850.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 22/11/21, ZCP	142.439	0,03	490.000	USD	Scripps Escrow II 15/01/31, 5.38%	482.466	0,12
195.800.000) JPY	Japan Treasury Discount Bill 29/11/21, ZCP	1.759.630	0,43	510.000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	434.926	0,11
240.450.000) JPY	Japan Treasury Discount Bill 06/12/21, ZCP	2.160.946	0,53	1.084.000	USD	Spirit Airlines 15/05/26, 1.00%	1.021.037	0,25
164.250.000) JPY	Japan Treasury Discount Bill 13/12/21, ZCP	1.476.154	0,36	930.000	USD	Uber Technologies 15/12/25, ZCP	909.196	0,22
226.850.000) JPY	Japan Treasury Discount Bill 20/12/21, ZCP	2.038.784	0,50	500.000	USD	United States Cash Management Bill		
194.200.000) JPY	Japan Treasury Discount Bill 06/01/22, ZCP	1.745.560	0,42	3.483.000	USD	15/10/21, ZCP United States Cash	499.988	0,12
37.700.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 25/01/22, ZCP	338.871	0,08			Management Bill 01/11/21, ZCP	3.482.820	0,85
15.800.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/02/22, ZCP	142.026	0,03	2.030.000	USD	United States Cash Management Bill	2 020 745	0.40
Mexiko		5.11 10/02/22, 2Cl	75.362	0,03	5.831.000	USD	25/01/22, ZCP United States Treasury	2.029.715	0,49
85.000	USD	Petroleos Mexicanos					Bill 05/10/21, ZCP	5.830.975	1,42
Danama		02/06/41, 6.50%	75.362	0,02	325.000	USD	United States Treasury Bill 07/10/21, ZCP	324.997	0,08
240.000	USD	Cable Onda	252.202	0,06	1.498.000	USD	United States Treasury		
	030	30/01/30, 4.50%	252.202	0,06			Bill 12/10/21, ZCP	1.497.974	0,36

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.995.000	USD	United States Treasury Bill 14/10/21, ZCP	1.994.978	0,48
7.970.000	USD	United States Treasury Bill 19/10/21, ZCP	7.969.791	1,94
7.734.000	USD	United States Treasury Bill 21/10/21, ZCP	7.733.744	1,88
8.539.000	USD	United States Treasury Bill 26/10/21, ZCP	8.538.692	2,07
6.107.000	USD	United States Treasury Bill 28/10/21, ZCP	6.106.773	1,48
5.540.000	USD	United States Treasury Bill 02/11/21, ZCP	5.539.705	1,35
9.840.000	USD	United States Treasury Bill 04/11/21, ZCP	9.839.514	2,39
200.000	USD	United States Treasury Bill 09/11/21, ZCP	199.986	0,05
2.700.000	USD	United States Treasury Bill 12/11/21, ZCP	2.699.858	0,66
410.000	USD	United States Treasury Bill 16/11/21, ZCP	409.978	0,10
1.205.000	USD	United States Treasury Bill 18/11/21, ZCP	1.204.906	0,29
750.000	USD	United States Treasury Bill 26/11/21, ZCP	749.965	0,18
500.000	USD	United States Treasury Bill 02/12/21, ZCP	499.971	0,12
500.000	USD	United States Treasury Bill 17/03/22, ZCP	499.896	0,12
1.500.000	USD	United States Treasury Bill 24/03/22, ZCP	1.499.652	0,36
1.365.000	USD	United States Treasury Bill 21/04/22, ZCP	1.364.611	0,33
Venezuela			13.200	-
220.000	USD	Petroleos de Venezuela 15/11/26, 6.00%*	13.200	_
Summe An	leihen		109.069.772	26,49
TBA-Wertp	apiere			
Vereinigte Staaten		1.847.771	0,45	
1.793.000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/51, 2.50%	1.847.771	0,45
Summe TB	A-Wertpap	iere	1.847.771	0,45
Summe üb Geldmarkt geregelten	instrumen	111.584.453	27,10	

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens				
Aktien								
Vereinigte :	Staaten		60.110	0,01				
7.200	USD	Payoneer	60.110	0,01				
Summe Aktien 60.110								
Summe sonstige Wertpapiere 60.110								

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Optionsscheine	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Kaimaninse	eln		10.297	-
15.800	USD	AEA-Bridges Impact Warrants 31/12/25	10.297	_
Vereinigte :	Staaten		189.095	0,05
10.500	USD	Churchill Capital VI Warrants 31/12/27	12.600	_
10.900	USD	Climate Real Impact Solutions II Acquisition Warrants 31/12/27	11.445	_
8.800	USD	Cohn Robbins Holdings Warrants 28/08/25	7.964	-
11.600	USD	Constellation Acquisition I Warrants 31/12/27	7.843	-
48.000	USD	Fortistar Sustainable Solutions Warrants 31/12/27	32.760	0,02
1.400	USD	Hamilton Lane Alliance Holdings I Warrants 08/01/26	1.120	_
13.200	USD	Jaws Mustang Acquisition Warrants 30/01/26	15.180	0,01
17.000	USD	JOFF Fintech Acquisition Warrants 31/12/27	11.560	-
9.260	USD	Metals Acquisition Warrants 12/07/23	6.482	-
17.276	USD	Payoneer Global Warrants 31/12/27	32.824	0,02
18.700	USD	Pontem Warrants 31/12/27	13.427	-
7.865	USD	Ribbit LEAP Warrants 09/09/25	10.618	-
11.700	USD	RMG Acquisition III Warrants 31/12/27	10.647	_
22.500	USD	Sustainable Development Acquisition I Warrants 31/12/28	14.625	_
Summe Op	tionsschei	ne	199.392	0,05
Summe Kap	pitalanlage	en	313.892.987	76,25
Sonstiges N	lettoverm	97.786.509	23,75	
Nettoinven	tarwert		411.679.496	100,00



^{*} Notleidendes Wertpapier

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2021

Die Gesellschaft

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

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

Anteilsklassen

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

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

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

Ausgabeaufschlag

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

Anteilsklassen	Ausgabeaufschlag
A¹-, A2- und K-Anteile	Bis zu 3,09278 % des Nettoinventarwerts je Anteil
A1-Anteile	Bis zu 2,04081 % des Nettoinventarwerts je Anteil
C-, C1-, E- und F-Anteile	Bis zu 1,01010 % des Nettoinventarwerts je Anteil
I-, IF-, N-, R- und X-Anteile	Kein Ausgabeaufschlag

Vertriebsgebühr

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

Swing-Pricing

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Teilfonds kann verwässert werden, wenn Anleger Anteile eines Teilfonds zu einem Kurs kaufen oder verkaufen, der die Handels- und sonstigen Kosten im Zusammenhang mit vom Anlageverwalter zur Berücksichtigung von Mittelzu- oder Mittelabflüssen vorgenommenen Wertpapiertransaktionen nicht berücksichtigt. Um diesen Auswirkungen entgegenzuwirken, kann ein Swing-Pricing-Mechanismus angewandt werden, um die Interessen der Anteilsinhaber des Teilfonds zu schützen. Wenn an einem Bewertungstag die kumulierten Nettotransaktionen mit Anteilen eines Teilfonds einen zuvor festgelegten Schwellenwert, der von der Verwaltungsgesellschaft für jeden Teilfonds bestimmt und in regelmäßigen Abständen überprüft wird, überschreiten, kann der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten hin angepasst werden, um 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 Handelsund sonstige Kosten angemessen wiedergibt. Derartige Anpassungen können von Teilfonds zu Teilfonds unterschiedlich ausfallen und betragen maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil.

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

Am 30. September 2021, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahres, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für den Schroder GAIA Cat Bond und den Schroder GAIA Sirios US Equity vorgenommen. Die nachfolgende Tabelle stellt den offiziellen Nettoinventarwert je Anteil dieser Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin dar. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

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

Swing-Pricing (Forts.)

	Währung	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Sirios US Equity
Nettoinventarwert je Anteil* (einschließlich Swing-Pricing-Anpassung)			
zum 30. September 2021			
Klasse A Thes.	USD	1.469,49	151,80
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	_	180,91
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	_	136,43
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	915,19	_
Klasse C Thes.	USD	1.478,61	158,38
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.162,20	187,04
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.223,70	142,22
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	105,05	148,06
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	_	147,96
Klasse E Thes.	USD	_	169,52
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	_	152,52
Klasse F Thes.	USD	1.468,51	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.157,32	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.215,87	-
Klasse F Aussch.	USD	1.175,04	_
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	SGD	1.571,49	-
Klasse I Thes.	USD	1.665,15	205,43
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.409,76	_
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.486,42	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	JPY	10.623,43	-
Klasse IF Thes.	USD	1.516,18	_
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.283,37	_
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.353,34	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	923,96	-
Klasse IF Aussch.	USD	1.398,41	_
Klasse X Thes.	USD	-	104,81
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	_	150,92

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



Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilsklassen		estanlage bei rstzeichnung		destanlage Folgezeich- nungen	Mir	ndestanlage- bestand
Schroder GAIA BlueTrend	Aliteliskiasseli	-	rstzeichhung		nungen		Destalla
Schroder GAIA Blue Frend	A-, C-, E- und N-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Cat Bond							
	A-, C- und F-Anteile	USD	100.000	USD	50.000	USD	100.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	IF-Anteile	USD	1.000.000	USD	500.000	USD	1.000.000
Schroder GAIA Contour Tech Equity							
	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Egerton Equity							
	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR	10.000	EUR	5.000	EUR	10.000
	I-Anteile	EUR	5.000.000	EUR	2.500.000	EUR	5.000.000
	X-Anteile	EUR	100.000.000	EUR	2.500.000	EUR	100.000.000
Schroder GAIA Helix							
	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	X-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA 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 Sirios US Equity	17.1110110				2.500.000		3,000,000
Schroder GALA Sirios OS Equity	A-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
		USD		USD		USD	
Colored CATA To Circus Biological	X-Anteile	USD	100.000.000	חצט	2.500.000		100.000.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
	C- und K-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
	C- und K-Anteile	GBP	10.000	GBP	5.000	GBP	10.000
	I-Anteile	GBP	5.000.000	GBP	2.500.000	GBP	5.000.000
	R-Anteile		Entfällt		Entfällt		Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
	A-, A1-, C-, C1- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000

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

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

Der Abschluss wird im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt und dargestellt. Während des Geschäftsjahres aufgelöste Teilfonds werden nach dem Nicht-Fortführungsprinzip aufgestellt.

Zum Berichtsdatum betrug der für den aufgelösten Teilfonds Schroder GAIA M&A* verwahrte Barbetrag 5.125 USD.

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

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

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

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

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

 $Anteile\ an\ of fenen\ OGA\ werden\ auf\ der\ Grundlage\ ihres\ von\ diesen\ OGA\ zuletzt\ gemeldeten\ Netto inventarwerts\ bewertet.$

Fair Value Pricing

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

Zum 30. September 2021 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP
	Manatee Re III Series B 07/06/22, variabel
	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variabel
	Voussoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Helix	CFD auf TRINITY LIMITED
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Payoneer Global
	Archaea Energy
	Clementia Pharmaceuticals

Besteuerung

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

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

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

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

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



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 das Berichtsjahr tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schroder GAIA BlueTrend		
	A-Anteile	1,60 %
	C-, E- und N-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Cat Bond	A 15 A 4 3	4.50.00
	A- und F-Anteile	1,50 %
	C- und IF-Anteile	1,10 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A	2.00 %
	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
Colored Contra Process Process	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Egerton Equity	A und A1 Antoile	2.00 %
	A- und A1-Anteile C- und E-Anteile	2,00 %
		1,25 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
Schroder GAIA Helix	I-Anteile	Entfällt
Schroder data nelix	A-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,00 %
	E-Anteile	0,75 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,60 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA M&A*	Trittene	Entrant
out out of the state of the sta	A-Anteile	1,50 %
	C-Anteile	0,75 %
	E-Anteile	0,50 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Oaktree Credit*		
	A2-Anteile	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 Two Sigma Diversified		
	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund		
	C¹- und R²-Anteile	0,75 %
	K³-Anteile	1,25 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Aad A1 Amtaila	3.00 %
	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.

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



 $^{^{\}mbox{\tiny 1}}$ 1,00 % bis zum 31. Oktober 2020, 0,75 % seit dem 1. November 2020.

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

 $^{^{\}rm 3}$ 1,50 % bis zum 31. Oktober 2020, 1,25 % seit dem 1. November 2020.

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

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

Performancegebühren

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

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

Nähere Einzelheiten zur Berechnung der während des Berichtsjahres angefallenen Performancegebühren sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für das Jahr zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter "Fällige Performancegebühren" ausgewiesen. Die während des Jahres für die einzelnen Anteilsklassen erhobenen Performancegebühren sind auf den Seiten 141-142 aufgeführt.

3	<u> </u>	
Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
Schroder GAIA BlueTrend Schroder GAIA BlueTrend BRL Abgesichert* Schroder GAIA BlueTrend CHF Abgesichert Schroder GAIA BlueTrend EUR Abgesichert Schroder GAIA BlueTrend GBP Abgesichert	Systematica Investments Limited Systematica Investments Limited Systematica Investments Limited Systematica Investments Limited Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA Contour Tash Equity	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA Contour Tech Equity Schroder GAIA Contour Tech Equity CHF Abgesichert	Contour Asset Management, LLC Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity EUR Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity GBP Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SEK Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SGD Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Egerton Equity	Egerton Capital (UK) LLP	EONIA + 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity GBP Abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	SONIA + 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity JPY Abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	Mutan JYMUON + 1.00 %
Schroder GAIA Egerton Equity USD Abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	US Overnight + 1,00 %
Schroder GAIA Helix	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix CHF Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix EUR Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix GBP Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix JPY Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix SGD Abgesichert Schroder GAIA M&A*	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA M&A CHF Abgesichert*	Schroder Investment Management Limited Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA M&A CHF Abgesichert*	Schroder Investment Management Limited Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA M&A GBP Abgesichert*	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Sirios US Equity	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity CHF Abgesichert	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR CHF 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity EUR Abgesichert	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR EUR 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity GBP Abgesichert	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR GBP 3 Month Act 365
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified CHF Abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified EUR Abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified GBP Abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund CHF Abgesichert		
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund EUR Abgesichert	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund USD Abgesichert		
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa BRL Abgesichert	Wellington Management International Limited Braz	•
Schroder GAIA Wellington Pagosa CHF Abgesichert	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa EUR Abgesichert Schroder GAIA Wellington Pagosa GBP Abgesichert	Wellington Management International Limited Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360 BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa SGD Abgesichert	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360

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

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

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

Für den Schroder GAIA Cat Bond und den Schroder GAIA Oaktree Credit* wird keine Performancegebühr berechnet.

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



Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

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

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

 $An lage verwalter k\"{o}nnen die von ihren Kontrahenten im Zusammenhang mit W\"{a}hrungsabsicherungsgesch\"{a}ften erhaltenen Barsicherheiten erneut investieren.$

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 30. September 2021 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	10.700.000	USD	7.919.174	20. Okt. 2021	(183.075)
AUD	650.000	USD	472.884	27. Okt. 2021	(2.919)
BRL	49.948.121	USD	9.453.123	15. Dez. 2021	(396.316)
CAD	28.560.970	USD	22.619.460	20. Okt. 2021	(70.741)
CAD	810.000	USD	637.241	27. Okt. 2021	2.244
CLP	360.953.658	USD	454.301	15. Dez. 2021	(12.119)
CNH	83.630	USD	12.916	8. Okt. 2021	50
CNH	171.680	USD	26.517	12. Okt. 2021	91
CNH	153.394.476	USD	23.695.727	20. Okt. 2021	62.589
CNH	104.008.654	USD	16.009.439	17. Nov. 2021	63.312
EUR	13.100.000	USD	15.451.578	20. Okt. 2021	(272.411)
EUR	400.000	USD	468.992	27. Okt. 2021	(5.444)
GBP	16.100.000	USD	22.252.869	20. Okt. 2021	(559.318)
GBP	300.000	USD	404.638	27. Okt. 2021	(406)
HUF	3.542.226.218	USD	12.055.617	20. Okt. 2021	(645.557)
IDR	263.886.958.901	USD	18.160.747	15. Dez. 2021	142.499
INR	2.744.532.174	USD	36.708.957	15. Dez. 2021	(15.143)
JPY	1.880.577.750	USD	17.164.947	20. Okt. 2021	(265.827)
JPY	55.485.000	USD	500.169	27. Okt. 2021	(1.549)
KRW	3.327.828.403	USD	2.867.974	15. Dez. 2021	(60.344)
MXN	766.558.305	USD	38.267.332	20. Okt. 2021	(1.227.517)
NOK	72.430.721	USD	8.373.235	20. Okt. 2021	(88.656)
NZD	22.900.000	USD	16.233.440	20. Okt. 2021	(425.848)
PHP	191.865.107	USD	3.816.174	15. Dez. 2021	(64.744)
PLN	14.016.796	USD	3.662.322	20. Okt. 2021	(138.173)
RUB	1.552.927.746	USD	20.949.913	15. Dez. 2021	87.072
SEK	130.343.690	USD	15.191.184	20. Okt. 2021	(300.468)
SGD	17.107.383	USD	12.743.370	20. Okt. 2021	(144.439)
SGD	2.500.000	USD	1.847.357	27. Okt. 2021	(6.227)
THB	63.292.041	USD	1.886.025	20. Okt. 2021	(15.655)
THB	3.877.462	USD	115.660	27. Okt. 2021	(1.080)
TWD	334.188.782	USD	12.134.785	15. Dez. 2021	(139.495)
USD	34.244.038	AUD	46.607.074	20. Okt. 2021	547.128
USD	5.097.099	AUD	7.035.000	27. Okt. 2021	10.633
USD	140.292	AUD	192.926	15. Jun. 2022	688
USD	69.322	BRL	368.496	27. Okt. 2021	1.906

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)	200.09		200.09	g	(Herere last,
USD	12.040.748	BRL	65.334.300	15. Dez. 2021	194.050
USD	21.545.015	CAD	27.420.224	20. Okt. 2021	(103.090)
USD	1.807.088	CAD	2.290.000	27. Okt. 2021	(839)
USD	312.735	CHF	290.000	27. Okt. 2021	1380
USD	15.698.164	CLP	12.372.397.962	15. Dez. 2021	541.483
USD	12.923	CNH	83.630	8. Okt. 2021	(43)
USD	26.533	CNH	171.680	12. Okt. 2021	(76)
USD	23.636.934	CNH	153.394.476	20. Okt. 2021	(121.384)
USD	458	CNH	2.974		• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •
				17. Nov. 2021	(1)
USD	10.521	CZK	230.000	27. Okt. 2021	16
USD	29.119.953	EUR	24.700.000	20. Okt. 2021	499.694
USD	10.521.551	EUR	9.005.000	27. Okt. 2021	85.932
USD	30.548.875	GBP	22.300.000	20. Okt. 2021	501.280
USD	1.726.132	GBP	1.275.000	27. Okt. 2021	8.146
USD	303.263	HKD	2.360.000	27. Okt. 2021	79
USD	17.318.515	HUF	5.237.478.194	20. Okt. 2021	447.784
USD	6.897	HUF	2.125.000	27. Okt. 2021	53
USD	1.285.492	IDR	18.747.476.467	15. Dez. 2021	(14.836)
USD	16.166.612	INR	1.204.158.769	15. Dez. 2021	67.265
USD	58.467.884	JPY	6.448.353.587	20. Okt. 2021	522.129
USD	1.356.310	JPY	151.205.000	27. Okt. 2021	(2.502)
USD	1.125.610	KRW	1.329.318.841	27. Okt. 2021	3.349
USD	17.077.447	KRW	20.035.430.256	15. Dez. 2021	173.905
USD	21.715.808	MXN	440.349.651	20. Okt. 2021	438.275
USD	7.331.671	NOK	63.907.983	20. Okt. 2021	21.917
USD	18.644.503	NZD	26.700.000	20. Okt. 2021	213.817
USD	31.173	NZD	45.000	27. Okt. 2021	112
USD	7.175.326	PHP	366.393.184	15. Dez. 2021	11.444
USD	22.353.236	PLN	86.688.306	20. Okt. 2021	557.776
USD	35.426	PLN	140.000	27. Okt. 2021	227
USD	1.601.510	RUB	118.836.212	15. Dez. 2021	(8.323)
USD	19.852.660	SEK	172.273.434	20. Okt. 2021	171.810
USD	244.076	SEK	2.130.000	27. Okt. 2021	729
USD	24.305.607	SGD	32.902.200	20. Okt. 2021	74.399
USD	2.306.619	SGD	3.130.000	27. Okt. 2021	1.525
USD	16.677.942	THB	545.973.788	20. Okt. 2021	543.643
USD	291.120	TRY	2.625.000	27. Okt. 2021	(447)
USD	19.297.305	TWD	536.396.572	15. Dez. 2021	44.019
USD	10.272.842	ZAR	152.775.071	20. Okt. 2021	150.339
USD	1.078.128	ZAR	16.300.000	27. Okt. 2021	(843)
ZAR	190.753.018	USD	13.250.188	20. Okt. 2021	(611.358)
				US	D 287.576
Absicherung der Anteilsklasse BRL	139.171.088	USD	26.301.670	29. Okt. 2021	(847.760)
CHF	400.784	USD	434.217	29. Okt. 2021	
					(3.899)
EUR	57.727.328	USD	67.700.485	29. Okt. 2021	(799.570)
GBP	49.585.985	USD	67.717.430	29. Okt. 2021	(903.104)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.	•	y-		J		(,
USD	, 380	GBP	281	29. Okt. 2021		2
030	300	GDI	201	23. OKt. 2021	USD	(2.554.405)
					USD	(2.266.829)
Schroder GAIA Cat Bond						(=.=00.0=0)
Absicherung des Portfolios						
USD	88.929.979	EUR	75.100.000	26. Nov. 2021		1.846.611
					USD	1.846.611
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	213.751.561	USD	231.595.761	29. Okt. 2021		(2.092.472)
EUR	678.745.043	USD	796.019.281	29. Okt. 2021		(9.413.244)
GBP	10.441	USD	14.257	29. Okt. 2021		(189)
JPY	1.265.657	USD	11.517	29. Okt. 2021		(143)
SEK	6.230.076.294	USD	720.474.917	29. Okt. 2021		(8.694.457)
SGD	747.326	USD	554.301	29. Okt. 2021		(3.935)
USD	1.548.240	CHF	1.431.529	29. Okt. 2021		11.221
USD	4.330.072	EUR	3.692.004	29. Okt. 2021		51.364
USD	70	GBP	52	29. Okt. 2021		1
USD	47	JPY	5.191	29. Okt. 2021		1
USD	5.435.433	SEK	46.988.582	29. Okt. 2021		67.031
USD	4.383	SGD	5.908	29. Okt. 2021		32
					USD	(20.074.790)
					USD	(18.228.179)
Schroder GAIA Contour Tech Equ	ity					
Absicherung des Portfolios						
AUD	2.893.887	USD	2.111.888	12. Nov. 2021		(19.402)
EUR	8.156.468	USD	9.589.024	12. Nov. 2021		(133.764)
GBP	3.069.115	USD	4.229.983	12. Nov. 2021		(94.513)
JPY	716.467.229	USD	6.512.269	12. Nov. 2021		(72.969)
NOK	99.504.350	USD	11.389.225	12. Nov. 2021		(10.107)
USD	2.000.101	AUD	2.744.860	12. Nov. 2021		15.372
USD	7.783.909	EUR	6.626.713	12. Nov. 2021		101.994
USD	5.752.765	GBP	4.201.098	12. Nov. 2021		92.006
USD	5.407.505	JPY	596.072.864	12. Nov. 2021		50.258
USD	9.109.117	NOK	80.004.590	12. Nov. 2021		(40.047)
					USD	(111.172)
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	4.862.870	USD	5.268.736	29. Okt. 2021		(47.514)
EUR	121.325.138	USD	142.281.343	29. Okt. 2021		(1.676.137)
GBP	29.042.078	USD	39.657.237	29. Okt. 2021		(524.669)
SEK	160.722.810	USD	18.586.632	29. Okt. 2021		(224.199)
SGD	1.012.945	USD	751.316	29. Okt. 2021		(5.335)
USD	57.978	CHF	54.195	29. Okt. 2021		(210)
USD	1.516.078	EUR	1.307.033	29. Okt. 2021		1.342
USD	470.239	GBP	349.626	29. Okt. 2021		(862)
USD	190.587	SEK	1.676.011	29. Okt. 2021		(896)
USD	8.715	SGD	11.861	29. Okt. 2021		(20)
					USD	(2.478.500)
					USD	(2.589.672)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity	Detiag	wan angen	Detiug	ramgheitsaatam		(Weitveilast)
Absicherung des Portfolios						
CHF	4.749.000	EUR	4.372.566	15. Okt. 2021		26.896
CNY	113.289.000	EUR	14.798.187	18. Okt. 2021		317.400
EUR	3.056.580	BRL	18.941.000	18. Okt. 2021		61.946
EUR	58.182.061	CAD	87.148.000	15. Okt. 2021		(1.202.47
	15.270.831		113.582.000			•
EUR		DKK		15. Okt. 2021		(2.29)
EUR	11.562.712	HKD	106.290.000	15. Okt. 2021		(222.400
EUR	5.703.701	IDR	96.774.759.000	18. Okt. 2021		(123.505
EUR	9.600.605	INR	841.109.000	18. Okt. 2021		(163.638
EUR	6.475.723	JPY	839.106.000	15. Okt. 2021		(32.154
EUR	7.202.962	RUB	625.887.000	15. Okt. 2021		(203.45
EUR	3.086.133	SEK	31.443.000	15. Okt. 2021		(14.133
EUR	4.347.799	SGD	6.905.000	15. Okt. 2021		(41.370
EUR	731.626.317	USD	864.914.000	15. Okt. 2021		(14.886.946
GBP	12.487.000	EUR	14.611.172	15. Okt. 2021		(89.260
HKD	31.059.000	EUR	3.416.384	15. Okt. 2021		27.345
USD	30.933.000	EUR	26.323.714	15. Okt. 2021		374.773
					EUR	(16.173.278
Absicherung der Anteilsklasse						
EUR	303.473	GBP	262.266	29. Okt. 2021		(1.459
EUR	1.754.093	USD	2.034.272	29. Okt. 2021		(1.23
GBP	47.438.431	EUR	55.253.066	29. Okt. 2021		(97.423
USD	359.651.708	EUR	306.680.176	29. Okt. 2021		3.655.205
					EUR	3.555.088
					EUR	(12.618.190
Schroder GAIA Helix						
Absicherung des Portfolios						
AUD	16.350.000	USD	12.019.558	28. Okt. 2021		(198.083
AUD	14.776.000	USD	10.878.790	18. Nov. 2021		(194.447
BRL	1.190.000	USD	226.108	4. Okt. 2021		(7.589
CAD	14.351.000	USD	11.403.589	28. Okt. 2021		(73.665
CHF	19.180.000	EUR	17.684.965	28. Okt. 2021		97.979
CHF	31.641.000	USD	34.473.660	28. Okt. 2021		(501.780
CLP	164.700.000	USD	219.723	14. Okt. 2021		(16.783
DKK	13.689.000	EUR	1.840.434	28. Okt. 2021		334
DKK	64.137.000	USD	10.165.713	28. Okt. 2021		(171.060
EUR	3.556.162	CHF	3.836.000	28. Okt. 2021		2.619
EUR	1.031.722	DKK		28. Okt. 2021		
			7.674.000			(209
EUR	126.807	GBP	108.000	28. Okt. 2021		1.432
EUR	581.422	NOK	6.073.000	28. Okt. 2021		(20.779
EUR	8.374.142	SEK	85.511.000	28. Okt. 2021		(64.769
ELID	190.000	USD	225.514	12. Okt. 2021		(5.392
	7- 0-0	LICIA	89.563.863	28. Okt. 2021		(1.520.31
EUR	75.972.251	USD				/EE 07
EUR GBP	8.583.432	EUR	10.028.257	28. Okt. 2021		
EUR GBP GBP	8.583.432 51.676.128	EUR USD	71.163.197	28. Okt. 2021		(1.532.61)
EUR GBP GBP	8.583.432	EUR				(1.532.61)
EUR GBP GBP GBP	8.583.432 51.676.128	EUR USD	71.163.197	28. Okt. 2021		(1.532.612 (75.388
EUR GBP GBP GBP HKD	8.583.432 51.676.128 1.893.000	EUR USD USD	71.163.197 2.626.099	28. Okt. 2021 18. Nov. 2021		(1.532.612 (75.388 (256.148
EUR EUR GBP GBP HKD JPY KRW	8.583.432 51.676.128 1.893.000 1.402.021.000	EUR USD USD USD	71.163.197 2.626.099 180.370.998	28. Okt. 2021 18. Nov. 2021 28. Okt. 2021		(55.977 (1.532.612 (75.388 (256.148 (388.554

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum		uwachs <i>i</i> tverlust
Schroder GAIA Helix (Forts.)	Detrug	waniangen	Detrug	rumgkeresautum	(WCI)	cveriuse
NOK	57.842.000	EUR	5.588.602	28. Okt. 2021		138.95
NOK	99.392.876	USD	11.324.865	28. Okt. 2021		42.95
NZD	944.000	USD	658.683	28. Okt. 2021		(7.082
NZD	2.233.000	USD	1.568.480	18. Nov. 2021		(27.408
PEN	615.000	USD	150.588	12. Nov. 2021		(1.997
RUB	8.495.000	USD	115.907	12. Okt. 2021		628
SEK	215.338.000	EUR	21.056.614	28. Okt. 2021		199.678
SEK	226.287.123	USD	26.089.337	28. Okt. 2021		(236.42
SGD	16.796.000	USD	12.391.201	28. Okt. 2021		(21.784
SGD	9.099.000	USD	6.722.592	18. Nov. 2021		(21.95)
USD	298.792	AUD	405.000	28. Okt. 2021		5.967
USD	787.074	AUD	1.100.000	18. Nov. 2021		(8.322
USD	223.499	BRL	1.190.000	4. Okt. 2021		4.980
USD	110.089	BRL	595.000	2. Dez. 2021		1.92
USD	197.126	CAD	246.000	28. Okt. 2021		2.913
USD	2.348.206	CHF	2.147.000	28. Okt. 2021		43.04
USD	801	CNH	5.184	8. Okt. 2021		(3
USD	16.273	DKK	103.000	28. Okt. 2021		22
USD	224.657	EUR	190.000	12. Okt. 2021		4.53
USD	53.441.677	EUR	45.453.203	28. Okt. 2021		766.36
USD	43.116.388	GBP	31.221.855	28. Okt. 2021	1	.046.75
USD	341.442	GBP	250.000	18. Nov. 2021		4.58
USD	33.626.982	HKD	261.593.000	28. Okt. 2021		20.648
USD	5.381.960	JPY	590.691.344	28. Okt. 2021		73.64
USD	222.727	KRW	254.635.000	12. Okt. 2021		7.697
USD	223.846	MXN	4.525.000	12. Okt. 2021		4.95
USD	4.911.278	NOK	43.259.969	28. Okt. 2021		(36.47
USD	111.863	RUB	8.495.000	12. Okt. 2021		(4.67)
USD	18.838.458	SEK	162.625.936	28. Okt. 2021		258.72
USD	1.681.808	SGD	2.264.000	28. Okt. 2021		14.48
030	1.001.000	300	2.204.000		JSD (2	2.709.45
Absicherung der Anteilsklasse				<u> </u>	(2	
CHF	6.021.496	USD	6.523.073	29. Okt. 2021		(57.84°
EUR	243.478.667	USD	285.543.470	29. Okt. 2021	(3	3.373.029
GBP	133.684.971	USD	181.836.459	29. Okt. 2021		.703.478
JPY	1.331.342	USD	12.115	29. Okt. 2021	(.	(15
SGD	49.623	USD	36.806	29. Okt. 2021		(26 ⁻
USD	17.482	CHF	16.157	29. Okt. 2021		134
USD						
	1.530.977	EUR	1.306.050	29. Okt. 2021		17.378
USD	509.359	GBP	373.541	29. Okt. 2021		6.034
USD	14	JPY	1.527	29. Okt. 2021		
USD	362	SGD	488	29. Okt. 2021		
						.111.21
Schrodor GATA Oalstraa Gradist					JSD (7	.820.66
Schroder GAIA Oaktree Credit* Absicherung des Portfolios						
Absicherung des Portfolios AUD	823	USD	608	20. Okt. 2021		(12
EUR	534.652	USD	631.646	20. Okt. 2021		(12.136
LUIN	JJ4.0JZ	030	051.040	20. UKL. 2021		(12,13

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

Cokoufto Wähmman	Gekaufter	Verkaufte	Verkaufter	Fälligheiterletung		Nicht realisierter Wertzuwachs/
Gekaufte Währungen	Betrag	Währungen	Betrag	Fälligkeitsdatum		(Wertverlust)
Schroder GAIA Oaktree Credit*		ELID	6 407 590	20 04 2021		155 227
USD	7.684.180	EUR	6.497.580	20. Okt. 2021		155.337
USD	1.138.080	GBP	824.525	20. Okt. 2021	USD	27.094 181.536
Absicherung der Anteilsklasse		-			ענט	181.530
CHF	1.599.182	USD	1.732.660	29. Okt. 2021		(15.630)
EUR	1.901.789	USD	2.230.383	29. Okt. 2021		(26.376)
GBP	20.347	USD	27.784	29. Okt. 2021		(368)
					USD	(42.374)
					USD	139.162
Schroder GAIA Sirios US Equity						
Absicherung des Portfolios						
EUR	2.916.000	USD	3.422.971	15. Dez. 2021		(39.944)
GBP	637.000	USD	867.423	15. Dez. 2021		(9.022)
USD	26.208.818	EUR	22.216.000	15. Dez. 2021		434.701
USD	21.584.055	GBP	15.685.000	15. Dez. 2021		447.463
USD	4.063.672	SEK	35.045.000	15. Dez. 2021		57.677
					USD	890.875
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	3.859.382	USD	4.181.547	29. Okt. 2021		(37.761)
EUR	92.148.927	USD	108.070.629	29. Okt. 2021		(1.278.098)
GBP	9.899.379	USD	13.517.882	29. Okt. 2021		(179.025)
USD	62.541	CHF	58.085	29. Okt. 2021		175
USD	3.308.673	EUR	2.836.756	29. Okt. 2021		21.121
USD	203.880	GBP	150.610	29. Okt. 2021	USD	940 (1.472.648)
					USD	(581.773)
Schroder GAIA Two Sigma Dive	rsified					(301.773)
Absicherung des Portfolios						
AUD	20.088.548	USD	14.755.332	15. Dez. 2021		(227.143)
BRL	28.464.106	USD	5.469.470	8. Okt. 2021		(246.732)
BRL	28.464.106	USD	5.224.967	1. Nov. 2021		(21.253)
CAD	29.651.782	USD	23.414.749	15. Dez. 2021		(4.603)
CHF	25.705.752	USD	28.070.251	15. Dez. 2021		(434.622)
CNH	34.265.420	USD	5.263.097	15. Dez. 2021		20.178
CZK	32.193.959	USD	1.501.282	15. Dez. 2021		(33.176)
EUR	40.000.000	USD	47.006.214	15. Dez. 2021		(599.809)
GBP	43.474.175	USD	60.188.546	15. Dez. 2021		(1.604.171)
HUF	460.828.765	USD	1.566.207	15. Dez. 2021		(84.782)
ILS	6.982.324	USD	2.184.073	15. Dez. 2021		(16.773)
INR	371.869.571	USD	5.077.238	7. Okt. 2021		(68.965)
INR	371.869.571	USD	5.007.670	29. Okt. 2021		(12.371)
JPY	2.834.550.500	USD	25.849.630	15. Dez. 2021		(363.798)
KRW	1.170.824.680	USD	1.004.000	15. Dez. 2021		(16.196)
MXN	192.527.317	USD	9.535.252	15. Dez. 2021		(307.369)
NOK	18.798.100	USD	2.171.288	15. Dez. 2021		(22.231)
NZD	14.947.081	USD	10.590.162	15. Dez. 2021		(277.435)
PLN	33.643.616	USD	8.845.714	15. Dez. 2021		(388.741)
RUB	306.532.773	USD	4.164.536	4. Okt. 2021		46.585
RUB	147.313.052	USD	2.008.933	22. Okt. 2021		8.133

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



	Gekaufter	Verkaufte	Verkaufter			Nicht realisierter Wertzuwachs/
Gekaufte Währungen	Betrag	Währungen	Betrag	Fälligkeitsdatum		(Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Di	versified (Forts.)					
RUB	159.219.721	USD	2.179.689	28. Okt. 2021		(2.037)
SEK	16.365.651	USD	1.879.793	15. Dez. 2021		(9.035)
SGD	10.741.310	USD	8.002.430	15. Dez. 2021		(92.881)
TWD	3.409.000	USD	122.626	7. Okt. 2021		(268)
USD	9.734.193	AUD	13.194.668	15. Dez. 2021		191.710
USD	5.241.574	BRL	28.464.106	8. Okt. 2021		18.837
USD	57.790.381	CAD	72.816.990	15. Dez. 2021		301.213
USD	18.478.272	CHF	17.004.739	15. Dez. 2021		196.889
USD	1.804.421	CNH	11.729.000	15. Dez. 2021		(4.036)
USD	1.156.048	CZK	25.467.500	15. Dez. 2021		(5.319)
USD	131.853.776	EUR	111.000.000	15. Dez. 2021		3.076.004
USD	18.706.343	GBP	13.739.880	15. Dez. 2021		190.932
USD	2.385.827	HUF	700.763.512	15. Dez. 2021		133.085
USD	596.698	ILS	1.908.000	15. Dez. 2021		4.459
USD	5.018.483	INR	371.869.571	7. Okt. 2021		10.211
USD	5.000.000	INR	372.450.000	29. Okt. 2021		(3.095)
USD	77.527.851	JPY	8.522.508.377	15. Dez. 2021		900.812
USD	11.014.312	KRW	12.786.901.926	15. Dez. 2021		226.226
USD	7.044.055	MXN	142.182.410	15. Dez. 2021		229.217
USD	8.708.927	NOK	75.551.172	15. Dez. 2021		71.683
USD	4.047.478	PLN	15.810.586	15. Dez. 2021		73.182
USD	4.204.114	RUB	306.532.773	4. Okt. 2021		(7.007)
USD	2.000.000	RUB	147.313.052	22. Okt. 2021		(17.066)
USD	4.666.719	SEK	39.944.603	15. Dez. 2021		100.649
USD	3.546.279	SGD	4.796.873	15. Dez. 2021		14.020
USD	123.403	TWD	3.409.000	7. Okt. 2021		1.045
USD	123.403	TWD	3.409.000	1. Nov. 2021		474
USD	227.015	TWD	6.252.435	15. Dez. 2021		2.591
USD	550.235	ZAR	7.959.511	15. Dez. 2021		27.037
ZAR	27.635.984	USD	1.909.603	15. Dez. 2021	HCD	(93.023)
Absicherung der Anteilsklasse					USD	881.235
CHF		USD	2 515 010	20 Okt 2021		(21.750)
	3.244.182		3.515.010	29. Okt. 2021		(31.759)
EUR	191.268.509	USD	224.316.073	29. Okt. 2021		(2.652.630)
GBP	217.158.222	USD	296.534.112	29. Okt. 2021		(3.925.619)
USD	68.905	CHF	63.995 4.250.444	29. Okt. 2021		195
USD	4.954.861	EUR		29. Okt. 2021		28.970
USD	5.696.838	GBP	4.217.346	29. Okt. 2021	uco	14.201
					USD	(6.566.642)
Sahwaday CATA IIV Dynamia	Sheelista Datisua Franci				USD	(5.685.407)
Schroder GAIA UK Dynamic A						
Absicherung der Anteilsklasse CHF		GRD	160 764	20 01+ 2021		752
	213.990	GBP	169.764	29. Okt. 2021		752
EUR	18.596.715	GBP	15.967.380	29. Okt. 2021		27.330
GBP	1.083	CHF	1.370	29. Okt. 2021		(8)
GBP	145.770	EUR	169.594	29. Okt. 2021		(94)
GBP	38.198	USD	52.308	29. Okt. 2021		(621)
USD	3.126.906	GBP	2.290.008	29. Okt. 2021	CDD	30.614
					GBP	57.973

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
•	-	wanifungen	Венау	ranigkeitsuatum	(wertveriust)
Schroder GAIA Wellington Pag Absicherung des Portfolios	OSa				
•	21 202 000	LICD	15 639 666	6 Old 2021	(172 101)
AUD AUD	21.392.000	USD	15.638.666	6. Okt. 2021	(173.191)
	698.000	USD	511.841	22. Okt. 2021	(7.182)
AUD	5.750.000	USD	4.153.907	4. Nov. 2021	3.621
AUD	1.045.000	USD	767.263	15. Dez. 2021	(11.511)
BRL	60.838.000	USD	11.541.679	4. Okt. 2021	(370.031)
BRL	24.373.000	USD	4.509.594	3. Nov. 2021	(55.097)
BRL	1.598.000	USD	302.480	12. Nov. 2021	(10.910)
BRL	27.845.000	USD	5.241.112	2. Dez. 2021	(179.293)
BRL	4.777.000	USD	874.092	10. Mrz. 2022	(23.684)
BRL	6.344.000	USD	1.157.136	14. Mrz. 2022	(28.763)
BRL	5.910.000	USD	1.060.565	14. Jul. 2022	(38.993)
CAD	9.854.112	USD	7.794.080	6. Okt. 2021	(14.145)
CAD	717.000	USD	574.144	7. Okt. 2021	(8.065)
CAD	215.000	USD	169.058	4. Nov. 2021	680
CAD	2.465.000	USD	1.948.119	15. Dez. 2021	(1.996)
CHF	1.597.800	USD	1.733.963	6. Okt. 2021	(19.401)
CHF	1.218.000	USD	1.334.437	15. Dez. 2021	(24.995)
CLP	9.640.331.000	USD	12.155.731	6. Okt. 2021	(267.946)
CLP	773.356.000	USD	1.100.863	29. Okt. 2021	(149.487)
CLP	1.434.500.000	USD	1.781.103	4. Nov. 2021	(17.496)
CLP	1.560.500.000	USD	1.974.299	15. Dez. 2021	(62.625)
CLP	723.204.000	USD	958.521	24. Dez. 2021	(73.283)
CLP	247.298.000	USD	337.378	30. Dez. 2021	(34.836)
CLP	249.646.000	USD	321.295	14. Feb. 2022	(17.109)
CLP	393.981.000	USD	487.902	14. Mrz. 2022	(9.019)
CNH	155.775.853	USD	24.056.072	8. Okt. 2021	95.140
CNH	2.125.000	USD	323.859	29. Okt. 2021	5.020
CNH	2.150.000	USD	332.884	6. Dez. 2021	(1.136)
CNH	30.252.000	USD	4.650.077	15. Dez. 2021	14.382
CNY	3.171.000	USD	490.260	8. Okt. 2021	323
CNY	115.360.000	USD	17.794.780	4. Nov. 2021	15.632
COP	12.163.174.000	USD	3.180.710	6. Okt. 2021	13.123
COP	2.716.300.000	USD	710.821	4. Nov. 2021	895
COP	11.409.900.000	USD	2.961.427	15. Dez. 2021	20.093
CZK	232.680.000	USD	10.818.761	6. Okt. 2021	(183.461)
CZK	33.620.000	USD	1.528.745	4. Nov. 2021	6.414
CZK	53.631.000	USD	2.489.845	15. Dez. 2021	(44.170)
DKK	484.000	USD	76.284	29. Okt. 2021	(860)
EGP	5.620.000	USD	341.019	12. Okt. 2021	15.604
EGP	23.726.000	USD	1.476.332	15. Dez. 2021	2.025
EUR	14.554.000	USD	17.105.588	6. Okt. 2021	(246.262)
EUR	707.000	USD	835.384	8. Okt. 2021	(16.363)
EUR	461.000	USD	547.207	14. Okt. 2021	(13.100)
EUR	3.072.000	USD	3.582.505	29. Okt. 2021	(22.327)
EUR	2.624.000	USD	3.052.800	4. Nov. 2021	(11.461)
EUR	8.204.000	USD	9.661.403	15. Dez. 2021	(143.451)
EUR	487.000	USD	569.060	10. Jan. 2022	(3.655)
GBP	15.836.000	USD	21.630.865	6. Okt. 2021	(293.407)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
_	•	waniungen	betrag	ranigkeitsuatum	(wertveriust)
Schroder GAIA Wellington F	298.000	USD	401.331	29. Okt. 2021	207
GBP					
	274.000	USD	387.984	13. Dez. 2021	(18.757)
GBP	3.562.000	USD	4.903.316	15. Dez. 2021	(103.281)
GBP	209.000	USD	285.886	22. Dez. 2021	(4.228)
GBP	236.000	USD	319.808	31. Mrz. 2022	(1.841)
HKD	7.350.000	USD	944.595	6. Okt. 2021	(423)
HUF	2.925.228.000	USD	9.786.396	6. Okt. 2021	(359.052)
HUF	2.143.400.000	USD	6.992.464	29. Okt. 2021	(90.432)
HUF	1.475.632.000	USD	4.944.387	15. Dez. 2021	(200.679)
HUF	2.143.400.000	USD	7.086.565	29. Jul. 2022	(273.546)
IDR	56.905.000.000	USD	3.988.417	6. Okt. 2021	(13.375)
IDR	48.521.000.000	USD	3.384.438	4. Nov. 2021	(4.905)
IDR	79.339.000.000	USD	5.516.374	15. Dez. 2021	(13.409)
ILS	36.598.820	USD	11.409.336	6. Okt. 2021	(57.049)
ILS	235.000	USD	73.136	4. Nov. 2021	(229)
ILS	3.415.000	USD	1.067.617	15. Dez. 2021	(7.608)
INR	1.282.387.000	USD	17.481.907	6. Okt. 2021	(209.123)
INR	923.657.000	USD	12.400.577	3. Nov. 2021	(624)
INR	96.891.000	USD	1.303.788	15. Dez. 2021	(8.376)
JPY	1.339.727.470	USD	12.028.238	6. Okt. 2021	9.559
JPY	342.500.000	USD	3.064.781	4. Nov. 2021	13.284
JPY	305.000.000	USD	2.775.130	15. Dez. 2021	(32.833)
KRW	10.226.830.000	USD	8.631.541	6. Okt. 2021	5.651
KRW	107.000.000	USD	90.152	4. Nov. 2021	168
KRW	1.410.057.000	USD	1.211.025	17. Nov. 2021	(21.010)
KRW	528.190.000	USD	453.320	15. Dez. 2021	(7.695)
KZT	60.700.000	USD	139.332	15. Dez. 2021	506
MXN	379.653.996	USD	18.860.150	6. Okt. 2021	(474.522)
MXN	259.389.000	USD	12.580.228	4. Nov. 2021	(73.032)
MXN	106.900.000	USD	5.259.854	15. Dez. 2021	(136.111)
NOK	131.913.000	USD	15.074.408	6. Okt. 2021	15.343
NOK	10.760.000	USD	1.230.532	4. Nov. 2021	50
NZD	10.545.000	USD	7.453.159	6. Okt. 2021	(173.495)
NZD	752.000	USD	519.399	22. Okt. 2021	(309)
NZD	4.030.000	USD	2.778.322	4. Nov. 2021	3.284
NZD	700.000	USD	495.116	15. Dez. 2021	(12.151)
PEN	14.615.000	USD	3.578.176	6. Okt. 2021	(43.470)
PEN	10.240.000	USD	2.476.720	4. Nov. 2021	(1.914)
PEN	14.155.000	USD	3.439.374	15. Dez. 2021	(24.912)
PHP	117.670.000	USD	2.337.608	6. Okt. 2021	(30.948)
PHP	142.450.000	USD	2.789.368	15. Dez. 2021	(4.122)
PLN	34.088.916	USD	8.672.524	6. Okt. 2021	(101.577)
PLN	4.945.000	USD	1.245.702	4. Nov. 2021	(2.450)
PLN	9.350.000	USD	2.374.473	15. Dez. 2021	(24.169)
RUB	796.187.000	USD	10.815.412	6. Okt. 2021	118.597
RUB	683.077.000	USD	9.348.170	3. Nov. 2021	(16.173)
RUB	244.858.000	USD	3.301.863	15. Dez. 2021	15.145
SEK	128.180.000	USD	14.730.262	6. Okt. 2021	(88.245)
SEK	1.578.000	USD	180.028	4. Nov. 2021	265

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pa	-		5		(**************************************
SGD	9.677.000	USD	7.202.159	6. Okt. 2021	(75.221)
SGD	5.472.000	USD	4.020.130	3. Nov. 2021	9.681
SGD	6.960.000	USD	5.168.771	15. Dez. 2021	(43.655)
THB	257.743.424	USD	7.944.370	6. Okt. 2021	(326.862)
ТНВ	52.580.000	USD	1.590.512	15. Dez. 2021	(37.147)
TRY	181.230.943	USD	20.836.628	6. Okt. 2021	(477.986)
TRY	61.616.000	USD	6.826.390	4. Nov. 2021	(12.154)
TRY	25.950.000	USD	2.895.887	15. Dez. 2021	(87.757)
TRY	4.846.000	USD	538.385	20. Dez. 2021	(15.462)
TWD	242.425.000	USD	8.783.112	6. Okt. 2021	(81.814)
TWD	34.850.000	USD	1.260.626	29. Okt. 2021	(9.796)
TWD	60.367.000	USD	2.173.234	4. Nov. 2021	(6.551)
TWD	72.975.000	USD	2.650.745	15. Dez. 2021	(31.398)
USD	13.505.682	AUD	18.573.000	6. Okt. 2021	78.219
USD	671.177	AUD	925.000	29. Okt. 2021	2.375
USD	1.276.813	AUD	1.770.000	4. Nov. 2021	(2.983)
USD	1.939.155	AUD	2.627.000	15. Dez. 2021	39.289
USD	11.430.608	BRL	60.838.000	4. Okt. 2021	258.961
USD	690.140	BRL	3.730.000	3. Nov. 2021	8.432
USD	295.678	BRL	1.598.000	12. Nov. 2021	4.108
USD	5.111.024	BRL	27.210.000	2. Dez. 2021	164.637
USD	116.929	BRL	640.000	10. Mrz. 2022	2.996
USD	268.550	BRL	1.540.000	14. Jul. 2022	2.354
USD	240.882	CAD	300.000	5. Okt. 2021	4.028
USD	25.526.198	CAD	32.234.553	6. Okt. 2021	76.649
USD	319.216	CAD	400.000	7. Okt. 2021	3.413
USD	199.988	CAD	250.000	12. Okt. 2021	2.613
USD	403.923	CAD	505.000	14. Okt. 2021	5.225
USD	217.412	CAD	275.000	20. Okt. 2021	301
USD	927.426	CAD	1.175.000	29. Okt. 2021	(220)
USD	683.236	CAD	845.000	3. Nov. 2021	16.124
USD	27.675	CAD	35.000	17. Nov. 2021	44
USD	697.983	CAD	900.000	1. Dez. 2021	(12.522)
USD	750.689	CAD	960.000	2. Dez. 2021	(7.180)
USD	157.845	CAD	200.000	6. Dez. 2021	(47)
USD	6.293.143	CAD	7.955.000	15. Dez. 2021	12.655
USD	316.866	CAD	400.000	20. Dez. 2021	1.055
USD	165.160	CAD	200.000	18. Jan. 2022	7.250
USD	319.691	CAD	400.000	26. Jan. 2022	3.875
USD	79.875	CAD	100.000	28. Jan. 2022	922
USD	199.014	CAD	250.000	23. Feb. 2022	1.643
USD	239.239	CAD	300.000	24. Feb. 2022	2.395
USD	273.069	CAD	346.000	7. Mrz. 2022	(84)
USD	161.336	CAD	200.000	12. Apr. 2022	3.465
USD	143.961	CAD	180.000	26. Apr. 2022	1.888
USD	206.871	CAD	250.000	11 Mai 2022	9.567
USD	1.727.107	CHF	1.587.788	6. Okt. 2021	23.288
USD	12.342.637	CLP	9.640.331.000	6. Okt. 2021	454.853
USD	496.956	CLP	382.789.000	29. Okt. 2021	26.052

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pag	-	wamangen	Detrug	ranigkeresautum	(Wereverlase)
USD	5.956.678	CLP	4.852.131.000	4. Nov. 2021	(8.641)
USD	4.125.687	CLP	3.273.530.000	15. Dez. 2021	115.482
USD	339.011	CLP	266.632.000	24. Dez. 2021	12.640
USD	75.902	CLP	58.900.000	30. Dez. 2021	3.844
USD	75.902 175.696	CLP		14. Feb. 2022	4.921
			140.155.000		
USD USD	353.914 6.736.559	CLP CNH	282.972.000 43.576.247	14. Mrz. 2022 8. Okt. 2021	9.962
					(19.426
USD	303.964	CNH	1.974.000	29. Okt. 2021	(1.546)
USD	2.224.262	CNH	14.419.000	4. Nov. 2021	(6.212)
USD	2.967.365	CNH	19.285.000	15. Dez. 2021	(6.128)
USD	605.926	CNH	3.967.000	15. Mrz. 2022	(1.399)
USD	17.832.465	CNY	115.360.000	8. Okt. 2021	(14.823)
USD	489.224	CNY	3.171.000	4. Nov. 2021	(346)
USD	65.065	CNY	422.000	15. Dez. 2021	114
USD	3.227.097	COP	12.163.174.000	6. Okt. 2021	33.265
USD	1.343.654	COP	5.165.274.000	4. Nov. 2021	(9.734)
USD	1.842.617	COP	7.112.000.000	15. Dez. 2021	(15.817)
USD	10.746.944	CZK	232.680.000	6. Okt. 2021	111.645
USD	2.807.173	CZK	60.760.000	15. Dez. 2021	36.400
USD	405.043	DKK	2.535.000	15. Dez. 2021	9.601
USD	17.180.401	EUR	14.554.000	6. Okt. 2021	321.074
USD	820.158	EUR	707.000	8. Okt. 2021	1.138
USD	1.334.340	EUR	1.143.000	14. Okt. 2021	10.079
USD	31.854.624	EUR	27.188.000	29. Okt. 2021	346.116
USD	7.631.613	EUR	6.570.000	4. Nov. 2021	16.677
USD	3.609.126	EUR	3.114.000	7. Dez. 2021	(2.724)
USD	12.317.777	EUR	10.391.000	15. Dez. 2021	262.554
USD	21.762.454	GBP	15.836.000	6. Okt. 2021	424.995
USD	7.136.510	GBP	5.237.000	29. Okt. 2021	79.948
USD	14.648.663	GBP	10.883.000	4. Nov. 2021	(15.666)
USD	1.058.333	GBP	781.000	13. Dez. 2021	5.900
USD	1.478.268	GBP	1.071.000	15. Dez. 2021	35.025
USD	944.652	HKD	7.350.000	6. Okt. 2021	480
USD	698.931	HKD	5.440.000	29. Okt. 2021	63
USD	422.468	HKD	3.290.000	4. Nov. 2021	(201)
USD	923.886	HKD	7.181.000	15. Dez. 2021	1.257
USD	9.811.929	HUF	2.925.228.000	6. Okt. 2021	384.584
USD	7.168.726	HUF	2.143.400.000	29. Okt. 2021	266.694
USD	711.510	HUF	221.028.000	4. Nov. 2021	(74)
USD	3.105.965	HUF	932.500.000	15. Dez. 2021	108.262
USD	6.920.668	HUF	2.143.400.000	29. Jul. 2022	107.649
USD	3.983.978	IDR	56.905.000.000	6. Okt. 2021	8.936
USD	2.305.976	IDR	33.184.000.000	15. Dez. 2021	4.328
USD	11.405.179	ILS	36.588.425	6. Okt. 2021	56.117
USD	4.132.618	ILS	13.291.000	4. Nov. 2021	9.193
USD	2.952.590	ILS	9.460.000	15. Dez. 2021	16.224
USD	17.284.895	INR	1.282.387.000	6. Okt. 2021	12.110
USD	584.889	INR	43.230.000	29. Okt. 2021	4.183
USD	5.269.340	INR	393.090.000	3. Nov. 2021	(7.833)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pa	•	waniangen	Detrug	ranigkeitsaatum	(Wertverlust)
USD USD	625.914	INR	46.374.000	9. Dez. 2021	5.518
USD	2.843.942	INR	211.550.000	15. Dez. 2021	15.564
USD	531.944	JPY	59.300.000	4. Okt. 2021	(874)
USD	12.106.353	JPY	1.334.072.799	6. Okt. 2021	119.363
USD	237.167	JPY	26.050.000	12. Okt. 2021	3.091
USD	1.762.068	JPY	193.400.000	18. Okt. 2021	24.173
USD	595.695	JPY	65.400.000	25. Okt. 2021	7.982
USD	2.343.560	JPY	259.500.000	29. Okt. 2021	11.516
USD	6.523.181	JPY	729.473.000	4. Nov. 2021	(32.630)
USD	500.979	JPY	55.000.000	8. Nov. 2021	6.676
USD	1.495.389	JPY	165.000.000	15. Nov. 2021	12.407
USD	144.544	JPY	15.850.000	22. Nov. 2021	2.081
USD	1.781.689	JPY	195.800.000	29. Nov. 2021	21.707
USD	2.187.076	JPY	240.450.000	6. Dez. 2021	25.554
USD	1.495.786	JPY	164.250.000	13. Dez. 2021	19.053
USD	1.495.786	JPY JPY	17.401.000	15. Dez. 2021	1.812
USD	2.066.489	JPY	226.850.000	20. Dez. 2021	26.642
		-	194.200.000		14.139
USD USD	1.760.917 345.074	JPY JPY	37.700.000	6. Jan. 2022	5.919
		-		25. Jan. 2022	
USD	144.315	JPY	15.800.000	10. Feb. 2022	2.156
USD	8.712.421	KRW	10.226.830.000	6. Okt. 2021	75.229
USD	9.099.760	KRW	10.788.510.000	4. Nov. 2021	(7.018)
USD	1.202.813	KRW	1.410.057.000	17. Nov. 2021	12.797
USD	2.168.300	KRW	2.536.510.000	15. Dez. 2021	28.292
USD	18.599.349	MXN	379.965.461	6. Okt. 2021	198.638
USD	5.341.817	MXN	110.230.000	4. Nov. 2021	26.757
USD	340.372	MXN	6.923.000	12. Nov. 2021	6.969
USD	3.959.578	MXN	80.462.000	15. Dez. 2021	103.014
USD	681.172	MXN	13.712.000	17. Dez. 2021	24.122
USD	346.612	MXN	7.239.000	10. Jan. 2022	858
USD	646.727	MXN	13.190.000	15. Mrz. 2022	22.671
USD	15.246.698	NOK	131.913.000	6. Okt. 2021	156.946
USD	10.194.067	NOK	89.563.000	4. Nov. 2021	(48.928)
USD	12.699.119	NZD	17.980.000	6. Okt. 2021	286.758
USD	179.874	NZD	260.000	22. Okt. 2021	401
USD	819.961	NZD	1.156.000	15. Dez. 2021	22.379
USD	3.548.054	PEN	14.615.000	6. Okt. 2021	13.347
USD	509.007	PEN	2.105.000	4. Nov. 2021	270
USD	1.915.263	PEN	7.905.000	15. Dez. 2021	8.422
USD	2.326.728	PHP	117.670.000	6. Okt. 2021	20.067
USD	961.355	PHP	49.255.000	4. Nov. 2021	(3.146)
USD	2.348.923	PHP	119.640.000	15. Dez. 2021	9.669
USD	8.708.716	PLN	34.059.592	6. Okt. 2021	145.140
USD	2.876.081	PLN	11.470.000	4. Nov. 2021	(7.660)
USD	5.169.098	PLN	19.952.000	15. Dez. 2021	153.777
USD	10.920.997	RUB	796.187.000	6. Okt. 2021	(13.012)
USD	144.960	RUB	10.590.000	3. Nov. 2021	283
USD	4.362.043	RUB	322.523.000	15. Dez. 2021	(7.068)
USD	343.670	RUB	26.143.000	27. Jan. 2022	(7.422)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pa	igosa (Forts.)	_	_	-		
USD	656.656	RUB	49.676.000	1. Mrz. 2022		(6.790)
USD	14.893.416	SEK	128.180.000	6. Okt. 2021		251.396
USD	11.233.797	SEK	98.541.000	4. Nov. 2021		(24.891)
USD	898.416	SEK	7.684.000	15. Dez. 2021		20.058
USD	7.132.939	SGD	9.677.000	6. Okt. 2021		6.001
USD	1.828.129	SGD	2.485.000	3. Nov. 2021		(1.929)
USD	6.488.640	SGD	8.750.000	15. Dez. 2021		45.427
USD	16.442.045	THB	537.754.847	6. Okt. 2021		548.905
USD	2.761.444	THB	91.610.000	15. Dez. 2021		55.021
USD	21.040.021	TRY	181.587.511	6. Okt. 2021		641.323
USD	14.241.161	TRY	128.455.000	4. Nov. 2021		35.067
USD	3.592.801	TRY	32.269.000	15. Dez. 2021		100.871
USD	8.762.481	TWD	242.425.000	6. Okt. 2021		61.184
USD	656.711	TWD	18.250.000	4. Nov. 2021		1.685
USD	3.886.202	TWD	107.075.000	15. Dez. 2021		42.878
USD	21.483.490	ZAR	314.589.000	6. Okt. 2021		598.815
USD	613.889	ZAR	9.503.000	25. Okt. 2021		(15.329)
USD	4.847.753	ZAR	73.729.000	4. Nov. 2021		(27.356)
USD	775.240	ZAR	11.760.000	12. Nov. 2021		(1.444)
USD	11.330.885	ZAR	165.804.000	15. Dez. 2021		432.189
ZAR	314.589.000	USD	21.161.834	6. Okt. 2021		(277.160)
ZAR	5.202.000	USD	350.067	25. Okt. 2021		(5.630)
ZAR	10.934.000	USD	737.462	12. Nov. 2021		(15.331)
ZAR	56.555.000	USD	3.849.709	15. Dez. 2021		(132.212)
ZAR	17.108.000	USD	1.088.295	24. Feb. 2022		25.238
Abeigh aware day Antaileklassa					USD	1.743.020
Absicherung der Anteilsklasse BRL	113.327.895	USD	21.402.767	29. Okt. 2021		(675.487)
CHF	4.242.693	USD	4.596.838	29. Okt. 2021		
EUR	86.554.319	USD	101.469.420	29. Okt. 2021 29. Okt. 2021		(41.492) (1.160.548)
GBP	45.004.631	USD	61.454.768	29. Okt. 2021 29. Okt. 2021		(813.559)
						,
SGD	2.671.869	USD	1.981.763	29. Okt. 2021		(14.068)
USD	412.199	BRL	2.237.791	29. Okt. 2021		2.914
USD	7.465	CHF	6.902	29. Okt. 2021		55
USD	164.899	EUR	140.647	29. Okt. 2021		1.902
USD	99.296	GBP	72.391	29. Okt. 2021		1.752
USD	3.876	SGD	5.228	29. Okt. 2021	HCD	26
					USD	(2.698.505)
					USD	(955.485)

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

		ľ	licht realisierte Wertzuwach
Teilfonds	Kontrahent		(Wertverlus
chroder GAIA BlueTrend			
	HSBC		(2.554.40
	UBS		287.5
		USD	(2.266.82
chroder GAIA Cat Bond	Drawn Drath and Harriman 9. Ca		1.046.6
	Brown Brothers Harriman & Co HSBC		1.846.6
	H2RC	USD	(20.074.7 (18.228.1)
chroder GAIA Contour Tech Equity		030	(10.220.1
on out. Grant contour real Equity	HSBC		(2.478.5
	Morgan Stanley		(111.1
	g,	USD	(2.589.6
chroder GAIA Egerton Equity			
	Brown Brothers Harriman & Co		(16.062.0
	HSBC		3.443.8
		EUR	(12.618.1
chroder GAIA Helix			
	Brown Brothers Harriman & Co		
	Goldman Sachs		(1.345.3
	HSBC		(5.111.2
	J.P. Morgan		(1.364.0
		USD	(7.820.6
chroder GAIA Oaktree Credit*			
	HSBC		(42.3
	State Street	HCD	181.5
ichrodor GATA Sirios IIS Equity		USD	139.1
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC		(1.472.6
	Morgan Stanley		890.8
	o.gae.aey	USD	(581.7
Schroder GAIA Two Sigma Diversified			
•	Citi Bank		721.4
	Deutsche Bank		(577.6
	HSBC		(6.566.6
	Morgan Stanley		212.6
	Newedge Group		524.8
		USD	(5.685.4
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund			
	HSBC		57.9
		GBP	57.9
chroder GAIA Wellington Pagosa			
	Bank of America		(12.4
	Barclays Bank		969.6
	BNP Paribas		(293.2
	Citi Bank		208.6
	Credit Suisse		58.5
	Deutsche Bank		7.1
	Goldman Sachs		(137.4
	HSBC		(2.654.5
	J.P. Morgan		5.0
	Morgan Stanley Standard Chartered Bank		1.095.1 (202.0
			(202 0

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



Kassageschäfte

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

Zum 30. September 2021 wies der folgende Teilfonds offene Kassageschäfte auf:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Ni	cht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma	Diversified					
Absicherung des Portfolios						
AUD	1.000.000	USD	723.730	1. Okt. 2021		(780)
CAD	1.716.820	GBP	1.000.000	1. Okt. 2021		8.056
CAD	1.000.000	JPY	87.685.000	1. Okt. 2021		1.654
CAD	2.543.050	USD	2.000.000	1. Okt. 2021		7.777
CZK	25.467.500	USD	1.158.667	1. Okt. 2021		5.487
EUR	1.000.000	CZK	25.467.500	1. Okt. 2021		(5.804)
EUR	1.000.000	GBP	862.330	1. Okt. 2021		(3.553)
EUR	1.000.000	GBP	860.550	4. Okt. 2021		(1.155)
EUR	3.000.000	USD	3.497.710	1. Okt. 2021		(22.660)
EUR	500.000	USD	579.582	4. Okt. 2021		(408)
GBP	1.862.330	USD	2.505.299	1. Okt. 2021		4.004
GBP	691.000	USD	930.632	4. Okt. 2021		421
JPY	87.685.000	USD	783.994	1. Okt. 2021		3.867
JPY	112.018.000	USD	1.000.000	4. Okt. 2021		6.496
SEK	10.203.700	EUR	1.000.000	1. Okt. 2021		7.201
SGD	1.357.490	USD	997.177	1. Okt. 2021		2.595
THB	2.023.600	USD	59.764	4. Okt. 2021		44
USD	720.530	AUD	1.000.000	1. Okt. 2021		(2.420)
USD	4.640.861	EUR	4.000.000	1. Okt. 2021		7.461
USD	1.159.891	SEK	10.203.700	1. Okt. 2021		(5.660)
USD	1.000.000	SGD	1.357.490	1. Okt. 2021		228
USD	938.751	THB	31.788.000	1. Okt. 2021		(749)
					USD	12.102

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	N	licht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified			
	Brown Brothers Harriman & Co		(408)
	Citi Bank		7.677
	Deutsche Bank		(3.717)
	Morgan Stanley		421
	Newedge Group		8.129
		USD	12.102

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter "Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten" aufgeführt. Zum 30. September 2021 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Aktienbezug), Rentenwerte und Währungen:

Fällig- keits-					(Short-)/ Long-	Markt-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung		preis	(Wertverlust)
Schroder GAIA	A BlueTren	d					
Mrz. 22	30	3 Month Euroswiss ICE Future	Morgan Stanley	CHF	8.107.999	100,72	(2.414)
Dez. 21	101	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	73.008.215	10,00	4.328
Mrz. 22	81	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	58.547.042	10,00	1.798
Jun. 22	78	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	56.361.323	10,00	12.094
Sep. 22	2	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	1.445.223	9,99	(107)
Jun. 22	75	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	18.708.338	99,80	3.225
Sep. 22	63	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	15.701.856	99,69	(1.469)
Dez. 22	49	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	12.194.350	99,51	(4.988)
März 24	48	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(11.852.050)	98,73	5.050
Jun. 24	41	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(10.111.375)	98,61	4.362
Sep. 24	44	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(10.841.300)	98,50	6.850
Dez. 24	38	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(9.352.850)	98,40	5.325
Mrz. 25	39	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(9.594.613)	98,32	8.412
Jun. 25	37	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(9.097.600)	98,26	9.013
Sep. 25	45	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(11.060.725)	98,20	13.788
Jun. 22	1	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(167.625)	99,37	261
Sep. 22	1	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(167.473)	99,26	303
Dez. 22	1	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(167.364)	99,19	312
März 24	956	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(159.755.033)	98,99	375.032
Okt. 21	7	Amsterdam Index Future	Credit Suisse	EUR	(1.294.109)	770,33	44.872
Dez. 21	221	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	22.937.908	141,47	(334.560)
Dez. 21	1.743	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	146.913.907	116,44	(190.063)
Mrz. 22	256	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	50.245.431	99,41	(17.103)
Jun. 22	49	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	(9.596.785)	99,21	2.112
Sep. 22	35	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	(6.840.508)	98,99	2.369
Dez. 22	33	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	(6.443.214)	98,77	9.829
Okt. 21	1.018	BIST 30 Index Futures	Morgan Stanley	TRY	(1.728.511)	1.517,75	(8.889)
Okt. 21	64	CAC 40 Index Future	Credit Suisse	EUR	4.913.283	6.518,00	(81.203)
Dez. 21	102	Canada 10 Year Bond Future	Credit Suisse	CAD	(11.584.052)	143,15	56.103
Okt. 21	4	CBOE VIX Future	Credit Suisse	USD	(89.950)	22,87	(1.521)
Nov. 21	8	CBOE VIX Future	Credit Suisse	USD	(186.850)	23,69	(2.637)
Dez. 21	2	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	889.309	15.288,00	(3.866)
Dez. 21	4	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Credit Suisse	USD	691.475	33.722,00	(17.035)
Dez. 21	4	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	880.200	4.297,75	(20.650)
Jun. 22	57	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(16.589.802)	100,49	3.258
Sep. 22	48	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(13.966.095)	100,45	3.345
Dez. 22	42	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(12.221.519)	100,42	7.761
März 24	143	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(41.502.116)	100,22	2.071
Dez. 21	3	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(709.443)	203,34	2.826
Dez. 21	60	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	2.887.952	4.048,00	(74.551)
Dez. 21	11	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(1.719.455)	134,93	197
Dez. 21	72	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	12.875.755	151,95	(202.943)
Dez. 21	37	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	7.373.164	169,82	(94.857)
Dez. 21	49	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(9.429.791)	165,95	10.610
Dez. 21	62	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	5.858.374	7.073,50	50.743
Okt. 21	141	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(2.179.589)	15.493,00	(4.924)
Dez. 21	25	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	3.704.490	25.373,00	(30.638)
Dez. 21	34	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(1.290.191)	58.181,00	(23.434)
Okt. 21	2	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(314.215)	24.524,00	(816)

Terminkontrakte (Forts.)

Fällig- keits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	W	t realisiertei ertzuwachs <i>i</i> Wertverlust
Schroder GA	AIA BlueTren	d (Forts.)		3		•	,	
Okt. 21	60	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(3.349.502)	8.721,00		(11.343
Okt. 21	3	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(304.217)	8.816,40		(2.15
Dez. 21	12	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	16.367.582	151,37		(46.63)
Dez. 21	48	KOSPI2 Index Future	Credit Suisse	KRW	(4.143.644)	401,50		74.38
Dez. 21	108	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(18.456.577)	125,15		244.85
Okt. 21	341	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	(1.407.436)			20.16
Dez. 21	28	MSCI EAFE Index Future	Credit Suisse	USD	3.327.100	2.267,00		(153.30
Dez. 21	6	MSCI Emerging Market Index Future	Credit Suisse	USD	(373.670)	1.245,60		(1
Okt. 21	50	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	1.321.244	353,50		(19.50
Dez. 21	3	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	907.476	14.682,50		(26.52
Dez. 21	10	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	2.684.751	29.460,00		(37.73
Dez. 21	7	Nikkei 225 (GSE) Future	Morgan Stanley	JPY	926.052	29.670,00		7.00
Okt. 21	33	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	(878.530)	2.253,25		29.16
Dez. 21	6	Russell 2000 E-mini Future	Credit Suisse	USD	672.905	2.200,80		(12.66
Dez. 21 Dez. 21	3	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	808.360	2.633,20		
	48	•	,					(18.40
Dez. 21		S&P/TSX 60 Index Future	Credit Suisse	CAD	9.267.031	1.196,10		(201.37
Dez. 21	546	SET 50 Index Future	Credit Suisse	THB	3.150.154	962,20		(44.72
Okt. 21	108	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	3.832.345	17.602,00		(30.31
Dez. 21	562	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	74.121.668	113,71		(97.29
Dez. 21	222	South Korea 10 Year Bond Future	Credit Suisse	KRW	(23.515.608)	124,21		226.23
Dez. 21	592	South Korea 3 Year Bond Future	Credit Suisse	KRW	(54.756.292)	109,40		56.29
Dez. 21	100	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	13.346.054	7.293,00		(164.86
Dez. 21	22	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	2.802.286	11.601,00		(63.70
Dez. 21	32	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	5.897.893	2.030,50		(59.71
Dez. 21	54	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	634.665	2.303,00		(9.29
Cabuaday C	NTA Ferretain I						USD	(813.88
Dez. 21	AIA Egerton I	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(00 956 242)	4 207 75		2 200 24
Dez. Z I	520	E-IIIIII S&P 500 Future	GOIGITIATI SACTIS	ענט	(99.856.343)	4.297,75	EUR	3.390.24 3.390.24
Schroder G <i>A</i>	ATA Haliv						EUK	3.330.24
Dez. 21	15	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(3.344.438)	4.297,75		121.12
Dez. 21	211	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(10.074.083)	4.048,00		180.29
Dez. 21	310	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(8.336.871)	453,10		201.72
Dez. 21	237	FTSE 100 Index Future	J.P. Morgan	GBP	(22.372.741)	7.073,50		(215.33
Dez. 21 Dez. 21	400	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(25.437.677)	23.049,00		592.69
			J.P. Morgan					
Dez. 21	53 105	MSCI Acia Future		USD	(3.366.719)	613,25		116.49
Dez. 21	105	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	(6.831.534)	632,30		192.38
Dez. 21	119	MSCI EASE Index Suture	J.P. Morgan	USD	(6.015.009)	992,60		109.03
Dez. 21	15	MSCI Francisco Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(1.763.465)	2.267,00		63.21
Dez. 21	374	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(24.060.490)	1.245,60		767.77
Dez. 21	79	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(2.806.930)	298,70		73.53
Dez. 21	203	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(6.573.888)	274,30		123.86
Dez. 21	341	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(7.213.097)	205,10		219.18
Dez. 21	59	MSCI Russia Future	Goldman Sachs	USD	(2.937.195)	1.023,80		(83.01
Dez. 21	208	MSCI Saudi Arabia Future	Goldman Sachs	USD	(3.467.405)	1.692,00		(51.95
Dez. 21	183	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(17.217.920)	9.133,00		504.53
	141	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(25.987.738)	2.030,50		263.26
Dez. 21	171	Topix Index ratare	J	J	(20.5071700)	2.050,50		203.20

Terminkontrakte (Forts.)

Fällig- keits-					(Short-)/ Long-	Markt-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung		preis	(Wertverlust)
Schroder GA	IA Two Sign	na Diversified					
Dez. 22	650	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(161.776.875)	99,51	81.250
Jun. 23	8	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(1.986.000)	99,22	1.700
Dez. 23	11	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	2.721.863	98,86	(3.350)
Jun. 24	26	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	6.419.060	98,61	(9.735)
Sep. 24	40	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	9.866.388	98,50	(16.888)
Dez. 24	20	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	4.931.638	98,40	(11.888)
Okt. 21	36	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	6.648.924	770,33	(224.280)
Dez. 21	211	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	21.978.976	141,47	(398.404)
Dez. 21	6	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(441.241)	72,34	7.201
Sep. 22	25	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(4.893.021)	98,99	8.635
Dez. 21	5	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	(428.231)	134,75	7.138
Okt. 21	93	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	7.122.035	6.518,00	(100.419)
Dez. 21	202	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	23.307.445	143,15	(477.586)
Dez. 21	5	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	394.275	78,99	675
Okt. 21	220	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(4.585.622)	22,87	(445.294)
Nov. 21	60	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1.311.978)	23,69	(109.176)
Dez. 21	100	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	45.471.246	15.288,00	(1.199.109)
Dez. 21	129	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	22.389.830	33.722,00	(639.140)
Okt. 21	15	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	405.340	134,29	(2.470)
Dez. 21	117	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	26.096.268	4.297,75	(954.430)
Dez. 21	30	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	7.318.664	203,34	(252.497)
Dez. 21	3	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	(442.786)	1,16	7.786
Dez. 21	748	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	35.979.173	4.048,00	(905.447)
Dez. 21	65	Euro Stoxx Bank Future	Credit Suisse	EUR	(353.876)	98,30	(16.188)
Dez. 21	31	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	4.877.673	134,93	(32.492)
Dez. 21	225	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	(40.129.750)	151,95	527.212
Dez. 21	684	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	136.733.436	169,82	(2.183.116)
Dez. 21	193	Euro-OAT Future	Credit Suisse	EUR	37.736.946	165,95	(636.907)
Dez. 21	11	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(1.430.817)	112,21	1.118
Dez. 21	249	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	(23.583.481)	7.073,50	(148.295)
Okt. 21	116	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	1.798.663	15.493,00	(1.475)
Dez. 21	35	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	(5.193.815)	25.373,00	50.423
Dez. 21	40	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(1.548.727)	58.181,00	3.287
Okt. 21	63	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(6.377.450)	8.816,40	(56.410)
Dez. 21	13	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	17.735.568	151,37	(54.540)
Dez. 21	4	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(451.438)	89,81	2.387
Dez. 21	251	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	3.148.469	1.454,90	(64.179)
Dez. 21	292	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(25.522.779)	401,50	768.133
Dez. 21	452	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	78.589.946	125,15	(2.370.494)
Dez. 21	17	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	421.770	4,80	(13.855)
Dez. 21	44	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(5.140.685)	2.267,00	153.285
Dez. 21	194	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(12.579.680)	1.245,60	497.360
Okt. 21	258	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(6.810.952)	353,50	93.984
Dez. 21	115	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	35.425.098	14.682,50	(1.655.348)
Dez. 21	6	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	426.690	69,05	(12.420)
Dez. 21	18	Nikkei 225 (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	4.791.680	29.460,00	(27.045)
Dez. 21	17	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(2.258.929)	29.305,00	20.801
Okt. 21	167	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	4.438.397	2.253,25	(140.070)
Dez. 21	1.392	RTS Index Future	Credit Suisse	USD	4.438.397	176.030,00	56.515
Dez. 21 Dez. 21	116	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(12.843.045)	2.200,80	78.405
Dez. 21 Dez. 21	30	Russian Ruble Future	Credit Suisse	RUB	(30.585)	73.681,00	218
Dez. 21	22	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	5.952.540	2.633,20	(159.500)

Terminkontrakte (Forts.)

Fällig- keits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	W	nt realisierter /ertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAI	IA Two Sign	na Diversified (Forts.)						
Dez. 21	57	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	11.051.934	1.196,10		(286.467)
Dez. 21	603	SET 50 Index Future	Credit Suisse	THB	(3.491.923)	962,20		62.299
Okt. 21	32	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	(1.131.509)	17.602,00		4.981
Dez. 21	265	Short-Term Euro-BTP Future	Credit Suisse	EUR	34.947.639	113,71		(42.905)
Dez. 21	74	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	7.906.250	124,21		(143.125)
Dez. 21	20	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1.854.561	109,40		(6.588)
Dez. 21	14	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	1.849.631	7.293,00		(4.265)
Dez. 21	10	Stoxx 600 Bank Future	Credit Suisse	EUR	(77.233)	138,90		(3.214)
Dez. 21	95	Stoxx Europe 600 Future	Credit Suisse	EUR	2.555.727	453,80		(58.845)
Dez. 21	3	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	410.069	107,42		(7.244)
Dez. 21	102	Topix Index Future	Credit Suisse	JPY	(18.816.299)	2.030,50		207.107
Dez. 21	3	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	(277.512)	94,24		(5.208)
Dez. 21	736	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	98.128.930	131,61		(1.264.430)
Dez. 21	600	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(132.178.125)	110,03		145.312
Dez. 21	154	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	19.010.086	122,74		(107.789)
Okt. 21	19	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	(188.235)	1.185,10		(1.942)
Dez. 21	44	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(7.146.782)	159,22		141.157
Dez. 21	10	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.940.156)	191,06		29.531
Okt. 21	55	VSTOXX Mini Future	Credit Suisse	EUR	(133.257)	23,20		(14.549)
Dez. 21	50	WIG20 Index Future	Credit Suisse	PLN	(594.682)	2.303,00	USD	15.639 (12.295.479)
Schroder GAI	IA UK Dyna	mic Absolute Return Fund						(12,250,175)
Dez. 21	36	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	(2.521.260)	7.073,50	GBP	(25.200) (25.200)
Schroder GAI	IA Wellingt	on Pagosa					- GDI	(23.200)
Sep. 22	_	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(100)	99,69		100
Dez. 21	177	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(18.153.414)	141,47		50.280
Dez. 21	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	2.025.338	116,44		(5.044)
Dez. 21	27	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	3.068.601	143,15		(17.085)
Dez. 21	20	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(1.988.197)	124,58		21.041
Okt. 21	28	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(603.850)	22,87		(36.448)
Dez. 21	6	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	1.293.450	4.297,75		(4.125)
Dez. 21	12	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	2.740.309	203,34		86.158
Dez. 21	28	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(1.350.138)	4.048,00		37.218
Dez. 21	251	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(39.276.798)	134,93		46.461
Dez. 21	_	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(25.959)	151,95		25.959
Dez. 21	156	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(30.934.153)	169,82		247.238
Dez. 21	80	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(15.595.341)	165,95		217.086
Dez. 21	70	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(9.098.526)	112,21		440
Dez. 21	15	KOSPI2 Index Future	Morgan Stanley	KRW	(1.312.016)	401,50		40.373
Dez. 21	79	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	13.398.438	125,15		(76.896)
Dez. 21	14	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(1.658.525)	2.267,00		71.625
Dez. 21	27	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(1.695.550)	1.245,60		13.990
Dez. 21	20	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(613.230)	14.682,50		25.929
Dez. 21	2	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(590.910)	14.682,50		3.610
Dez. 21	1	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	111.805	2.200,80		(1.765)
Dez. 21	32	S&P500 Micro E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(717.270)	4.297,75		29.630
Dez. 21	746	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(98.291.750)	131,61		111.156
Dez. 21	2	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(299.781)	145,25		9.281
Dez. 21	283	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	62.301.821	110,03		(26.344)
Dez. 21	516	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(63.434.296)	122,74		99.327
Dez. 21	9	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.469.594)	159,22		36.625
Dez. 21	37	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	7.260.375	191,06		(191.063)
							USD	814.757

Optionskontrakte

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

Zum 30. September 2021 wiesen die folgenden Teilfonds offene Optionskontrakte auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Blo	ueTrend					
(1 210 224)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 90,77 Läuft am 1. Okt. 2021 ab	UBS	USD	(6.442)		6 442
(1.318.324)	Laurt am 1. Okt. 2021 ab	OR2	OSD	(6.443)	USD -	6.443 6.443
Schroder GAIA He	elix					
	Put auf Deutsche Börse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 15.000,00					
223	Läuft am 15. Okt. 2021 ab Put auf FTSE 100 Index	Goldman Sachs	EUR	189.203	197.609	8.406
53	Ausübungskurs 6.700,00 Läuft am 17. Dez. 2021 ab Put auf MSCI Emerging Markets Index	Goldman Sachs	GBP	95.674	82.302	(13.372)
14	Ausübungskurs 1.230,00 Läuft am 15. Okt. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	19.792	23.590	3.798
5	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.275,00 Läuft am 15. Okt. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	18.369	28.525	10.156
73	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.325,00 Läuft am 15. Okt. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	294.426	544.580	
					USD 876.606	259.142
Schroder GAIA Sir						
50	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.100,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab Put auf S&P 500 Index	Goldman Sachs	USD	916.400	1.189.750	273.350
35	Ausübungskurs 4.100,00 Läuft am 16. Sept. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	872.499	1.020.775 USD 2.210.525	
Schrodor GATA III	C Dynamic Absolute Return Fund				2.2.10.525	
Schlodel GAIA OF	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 6.700,00					
37	Läuft am 17. Dez. 2021 ab	Morgan Stanley	GBP	48.531	42.642 GBP 42.642	(,
Schroder GAIA Wo	ellington Pagosa					
90.526	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 6,30	Coldman Sachs	ELID	10 127	17 100	(1.027)
90.326	Läuft am 17. Dez. 2021 ab Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 6,40	Goldman Sachs	EUR	19.127	17.190	(1.937)
272.000	Läuft am 18. Mrz. 2022 ab Call auf Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index	Goldman Sachs	EUR	82.970	92.076	9.106
19.487.029	Ausübungskurs 2,50 Läuft am 16. Dez. 2022 Call auf Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index	Goldman Sachs	USD	216.902	100.962	(115.940)
17.905.507	Ausübungskurs 2,50 Läuft am 17. Dez. 2021 Call auf Financial Select Sector SPDR Fund	Goldman Sachs	USD	176.846	34.325	(142.521)
6.750	Ausübungskurs 481,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab Call auf Financial Select Sector SPDR Fund	Morgan Stanley	USD	139.616	166.222	26.606
5.136	Ausübungskurs 494,00 Läuft am 19. Nov. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	29.532	15.123	(14.409)

Call oder Put zugrunde lieger der Nennwert	n- Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA \	Wellington Pagosa (Forts.)					
	Call auf Financial Select Sector SPDR Fund					
3.850	Ausübungskurs 506,00 Läuft am 17. Dez. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	23.485	11.279	(12.206)
	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs	3				,
(1.155.000)	Ausübungskurs 81,12 Läuft am 12. Okt. 2021 ab	Citi Bank	AUD	(8.554)	(2.882)	5.672
(1.133.000)	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs	Citi Barik	7100	(0.554)	(2.002)	3.072
(1.155.000)	Ausübungskurs 81,58	BNP Paribas	AUD	(0.726)	(2.40)	0.200
(1.155.000)	Läuft am 5. Okt. 2021 ab Call auf EUR/AUD-Devisenkurs	DINP Paribas	AUD	(8.736)	(348)	8.388
0.54.000	Ausübungskurs 1,60	611 B	5115		5.070	(0.050)
961.000	Läuft am 13. Okt. 2021 ab Call auf EUR/AUD-Devisenkurs	Citi Bank	EUR	8.830	5.878	(2.952)
	Ausübungskurs 1,61					
959.000	Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf EUR/BRL-Devisenkurs	Bank of America	EUR	8.788	7.040	(1.748)
	Ausübungskurs 6,29					
(713.000)	Läuft am 26. Okt. 2021 ab	Bank of America	EUR	(14.826)	(16.257)	(1.431)
	Call auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 6,29					
(720.000)	Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	(15.796)	(9.659)	6.137
	Call auf EUR/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,64					
721.000	Läuft am 12. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	4.335	37	(4.298)
	Call auf EUR/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,67					
721.000	Läuft am 5. Okt. 2021 ab	Deutsche Bank	EUR	4.606	-	(4.606)
	Call auf EUR/JPY-Devisenkurs					
1.078.000	Ausübungskurs 128,50 Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	8.535	9.236	701
	Call auf EUR/MXN-Devisenkurs					
713.000	Ausübungskurs 23,65 Läuft am 26. Okt. 2021 ab	Bank of America	EUR	8.123	15.445	7.322
	Call auf EUR/MXN-Devisenkurs					
720.000	Ausübungskurs 23,68 Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	7.853	10.555	2.702
, 20,000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs	e. gan etae,	2011	7.000	. 0.000	
840.000	Ausübungskurs 1,66 Läuft am 13. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	8.655	13.487	4.832
840.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs	CICI Dalik	LOK	8.033	13.407	4.032
929 000	Ausübungskurs 1,67	Citi Dank	ELID	2.066	10.055	1.000
838.000	Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf EUR/SEK-Devisenkurs	Citi Bank	EUR	8.966	10.055	1.089
	Ausübungskurs 10,20					
730.000	Läuft am 28. Okt. 2021 ab Call auf EUR/USD-Devisenkurs	Bank of America	EUR	4.460	2.426	(2.034)
	Ausübungskurs 1,16					
3.272.000	Läuft am 6. Jan. 2022 ab Call auf EUR/USD-Devisenkurs	Goldman Sachs	EUR	41.535	41.414	(121)
	Ausübungskurs 1,17					
1.198.000	Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	EUR	8.639	1.496	(7.143)
	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,18					
1.074.000	Läuft am 16. Nov. 2021 ab	Bank of America	EUR	13.705	1.878	(11.827)
	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,19					
1.028.000	Läuft am 31. Jan. 2022 ab	BNP Paribas	EUR	19.267	3.684	(15.583)
	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,19					
1.089.000	Läuft am 4. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	EUR	14.935	-	(14.935)
	Call auf EUR/USD-Devisenkurs					
1.202.000	Ausübungskurs 1,19 Läuft am 6. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	EUR	8.398	_	(8.398)
	Call auf EUR/USD-Devisenkurs	-				
1.030.000	Ausübungskurs 1,21 Läuft am 14. Feb. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	7.121	1.877	(5.244)
		<i>3</i>		• •		(3.2)

Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA W	/ellington Pagosa (Forts.)					
	Call auf EUR/USD-Devisenkurs					
3.004.000	Ausübungskurs 1,22 Läuft am 3. Dez. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	51.134	471	(50.663)
5.0000	Call auf EUR/ZAR-Devisenkurs	Goraman Sacris	2011	33	.,.	(55.555)
(730.000)	Ausübungskurs 17,70 Läuft am 28. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	(14.118)	(9.912)	4.206
(730.000)	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs	Morgan stanley	LON	(14.110)	(3.312)	4.200
024 000	Ausübungskurs 1,88	Danis of Amarica	CDD	0.265	4 4 4 7	(4.240)
821.000	Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf GBP/AUD-Devisenkurs	Bank of America	GBP	8.365	4.117	(4.248)
	Ausübungskurs 1,88					
811.000	Läuft am 30. Sep. 2021 ab Call auf GBP/JPY-Devisenkurs	Barclays Bank	GBP	8.226	_	(8.226)
	Ausübungskurs 152,08					
720.000	Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf GBP/USD-Devisenkurs	Deutsche Bank	GBP	8.140	565	(7.575)
	Ausübungskurs 1,38					
923.000	Läuft am 13. Okt. 2021 ab	Deutsche Bank	GBP	8.955	214	(8.741)
	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,38					
659.000	Läuft am 18. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	GBP	12.379	234	(12.145)
	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,38					
670.000	Läuft am 3. Dez. 2021 ab	Bank of America	GBP	11.803	2.585	(9.218)
	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,38					
620.000	Läuft am 5. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	GBP	6.278	2	(6.276)
	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,39					
926.000	Läuft am 6. Okt. 2021 ab	BNP Paribas	GBP	8.789	4	(8.785)
	Call auf NZD/USD-Devisenkurs					
775.000	Ausübungskurs 0,70 Läuft am 15. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	NZD	9.652	3.059	(6.593)
	Call auf NZD/USD-Devisenkurs					
1.205.000	Ausübungskurs 0,70 Läuft am 27. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	NZD	9.128	3.566	(5.562)
	Call auf NZD/USD-Devisenkurs	,				
1.195.000	Ausübungskurs 0,71 Läuft am 30. Sep. 2021 ab	J.P. Morgan	NZD	8.724	_	(8.724)
	Call auf NZD/USD-Devisenkurs	J		J.,		(,
(1.205.000)	Ausübungskurs 0,71 Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	NZD	(9.769)	(241)	9.528
(1.203.000)	Call auf USD/BRL-Devisenkurs	Worgan Starticy	NZD	(3.703)	(241)	5.520
1.856.000	Ausübungskurs 5,98 Läuft am 8. Mrz. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	38.740	43.368	4.628
1.050.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs	Deatselle Balik	030	30.740	43.300	4.020
2.465.000	Ausübungskurs 6,00	Goldman Sachs	USD	50.614	E7 200	6.674
2.465.000	Läuft am 10. Mrz. 2022 ab Call auf USD/BRL-Devisenkurs	GOIGITIATI SACTIS	030	50.614	57.288	0.074
2 444 000	Ausübungskurs 6,34	Davita da a Davido	HCD	74.640	75 422	01.4
2.444.000	Läuft am 12. Jul. 2022 ab Call auf USD/CHF-Devisenkurs	Deutsche Bank	USD	74.618	75.432	814
	Ausübungskurs 0,91					
1.104.000	Läuft am 11. Okt. 2021 ab Call auf USD/CHF-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	13.855	21.753	7.898
	Ausübungskurs 0,91					
1.081.000	Läuft am 26. Nov. 2021 ab Call auf USD/CLP-Devisenkurs	BNP Paribas	USD	13.511	25.383	11.872
	Ausübungskurs 767,00					
855.000	Läuft am 6. Okt. 2021 ab	Bank of America	USD	13.285	46.483	33.198
	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 786,70					
(2.428.000)	Läuft am 2. Dez. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	(74.345)	(111.201)	(36.856)
	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 791,25					
852.000	Läuft am 12. Okt. 2021 ab	Bank of America	USD	13.434	22.811	9.377

Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,50	Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Call auf USD/CLP Devisenhurs Ausburgsturs Ausburgsturs Section Call auf USD Call auf	Schroder GAIA W	ellington Pagosa (Forts.)					
1,852,000							
Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6,46	(1.852.000)		Goldman Sachs	HSD	(32 110)	(41.629)	(0.510)
L200.000	(1.032.000)		Goldman Sachs	030	(32.110)	(41.023)	(5.515)
Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.50 843.000 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.50 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 13.521 9.208 (4.318 L1.587.000 Läuft am 9. Dev. 2021 ab Barclays Bank USD 13.521 9.208 (4.318 L1.597.000 Läuft am 9. Dev. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.52 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.55 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.55 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.68 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.68 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.68 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.68 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChH-Devisenkurs Ausübungskurs 6.68 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 21.81 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 21.81 L212.000 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 21.81 L212.000 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 11.81 L212.000 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 12.61 L212.000 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 13.63,77 L22.000 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 13.63,77 L22.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 14.77,300 Läuft am 5. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 14.77,300 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 14.77,300 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 3.21 L212.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 3.21 L212.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungskurs 3.21 L212.0000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/ChP-Devisenkurs Ausübungs		Ausübungskurs 6,46					
Ausbibungskurs 6,50	1.220.000		Goldman Sachs	USD	17.693	9.656	(8.037)
EASTOON Lauft am ZO, Okt. 2021 ab							
Ausübungskurs 6,50	(843.000)	<i>5</i> ,	Morgan Stanley	USD	(4.268)	(1.163)	3.105
1.587.00							
Call and USD/CNH-Devisenkurs Ausbhungskurs 6,52	1.587.000		Barclavs Bank	USD	13.521	9.208	(4.313)
1.579.00			,			2,	(,
Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6,56	1 570 000		Daniela da Daniela	LICD	42.050	1 200	(42.560)
Ausbbungskurs 6.56 Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6.63 Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6.63 Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6.63 Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6.68 Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6.68 Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbbungskurs 6.68 Call auf USD/CZK-Devisenkurs Call auf USD/USD-Devisenkurs Call a	1.579.000		Barciays Bank	USD	13.958	1.389	(12.569)
Call auf USD/CNI-Devisenkurs Ausübungskurs 6,63 (1,220,000) Lauft am 2. Dez. 2021 ab Goldman Sachs USD (7,288) (1,596) 5,692 (201 auf USD/CNI-Devisenkurs Ausübungskurs 6,68 (1,122,000) Lauft am 2. Dez. 2021 ab Morgan Stanley USD (4,768) (140) 4,628 (1,122,000) Lauft am 30, Nov. 2021 ab Morgan Stanley USD (10,074 13,173 3,095 (201 auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,63 (201 auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,63 (201 ab USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,81 (201 ab USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 20,21 ab Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 30,279 (2,181 (2							
Ausübungskurs 6,63 Call auf USD/CNI-Devisenkurs Ausübungskurs 6,68 Call auf USD/CNI-Devisenkurs Ausübungskurs 6,68 Call auf USD/CXI-Devisenkurs Ausübungskurs 6,68 Call auf USD/CXI-Devisenkurs Ausübungskurs 1,68 Call auf USD/CXI-Devisenkurs Ausübungskurs 2,18 Call auf USD/CXI-Devisenkurs Ausübungskurs 302,79 Call auf USD/HUI-Devisenkurs Ausübungskurs 302,79 Call auf USD/HUI-Devisenkurs Ausübungskurs 303,97 Call auf USD/HUI-Devisenkurs Ausübungskurs 303,97 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,370,00 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf U	1.212.000		Morgan Stanley	USD	11.284	752	(10.532)
1,122,000 Lauft am Z. Dez. 2021 ab Goldman Sachs USD (7,288) (1,596) 5,692							
Ausübungskurs 6,68 1,212,000	(1.220.000)		Goldman Sachs	USD	(7.288)	(1.596)	5.692
1,1212.000							
Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,63	(1.212.000)		Morgan Stanley	USD	(4.768)	(140)	4.628
S70,000	(112121000)		o. ga o.aoj	002	(00)	(1.10)	
Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,81 Läuft am 11. Okt. 2021 ab J.P. Morgan USD 11.000 4.863 (6.137 Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 30,79 2.390.000 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 303.97 2.376.000 Läuft am 25. Okt. 2021 ab Call auf USD/INE-Devisenkurs Ausübungskurs 14,370,00 Sall auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,370,00 Läuft am 21. Oet. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,377,00 Läuft am 27. Oet. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 8. Nov. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 6. Det. 2021 ab Deutsche Bank USD Gall auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 6. Det. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 6. Det. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 6. Det. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD Gall auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 7,419 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,419 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,44 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 7,544	670,000		Managa Charley	LICD	10.074	12.172	2.000
Ausübungskurs 21,81 Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausubungskurs 302,79 2,390,000 Läuft am 20, Okt. 2021 ab Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausubungskurs 302,79 2,397,000 Läuft am 20, Okt. 2021 ab Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 303,79 2,376,000 Läuft am 25, Okt. 2021 ab Call auf USD/INDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 21, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,510,00 Läuft am 8, Nov. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 6, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 6, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Läuft am 6, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 6, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 6, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Läuft am 10, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Läuft am 21, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Läuft am 21, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Läuft am 21, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Läuft am 21, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Läuft am 21, Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	670.000		Morgan Stanley	USD	10.074	13.173	3.099
Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 302,79 Läuft am 20. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 24.617 61.416 36.799 Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 303,97 2.376.000 Läuft am 25. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 24.116 54.879 30.763 Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 14.370,00 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.370,00 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.510,00 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.510,00 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.773,00 Devisenkurs Ausübungskurs 14.773,00 Devisenkurs Ausübungskurs 14.773,00 Deutsche Bank USD 6.871 4.848 (2.023 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.773,00 Deutsche Bank USD 7.411 8.860 1.449 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Bank of America USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Bank of America USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Ausübungskurs 75,84 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,650							
Ausübungskurs 302,79	679.000		J.P. Morgan	USD	11.000	4.863	(6.137)
Läuft am 20. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 24.617 61.416 36.795 Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 303,97 2.376.000 Läuft am 25. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 24.116 54.879 30.763 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.370,00 Eläuft am 21. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 9.991 10.386 395 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.510,00 Eläuft am 8. Nov. 2021 ab Barclays Bank USD 10.659 3.256 (7.403 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.773,00 Eläuft am 6. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.871 4.848 (2.023 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Eff8.000 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Morgan Stanley USD 7.411 8.860 1.449 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Eff8.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD (4.897) (6.651) (1.754 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Eff8.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Eff8.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab Bank of America USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Eff7.000 Läuft am 5. Nov. 2021 ab Bank of America USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Eff8.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Eff8.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50							
2.376.000 Läuft am 25. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 24.116 54.879 30.763 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.370,00 571.000 Läuft am 21. Dez. 2021 ab Bank of America USD 9.991 10.386 395 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.510,00 Läuft am 8. Nov. 2021 ab Barclays Bank USD 10.659 3.256 (7.403 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.773,00 Läuft am 6. Dez. 2021 ab Deutsche Bank USD 6.871 4.848 (2.023 Call auf USD/IDS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Morgan Stanley USD 7.411 8.860 1.449 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 S80.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Bank of America USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84	2.390.000		Barclays Bank	USD	24.617	61.416	36.799
Läuft am 25. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 24.116 54.879 30.763 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,370,00 Läuft am 21. Dez. 2021 ab Bank of America USD 9.991 10.386 395 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,510,00 Läuft am 8. Nov. 2021 ab Barclays Bank USD 10.659 3.256 (7.403 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 297.000 Läuft am 6. Dez. 2021 ab Deutsche Bank USD 6.871 4.848 (2.023 Call auf USD/IDS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf USD/IDS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Morgan Stanley USD 7.411 8.860 1.445 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 R55.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD (4.897) (6.651) (1.754 Call auf USD/IDS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 S67.000 Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Läuft am 5. Nov. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 S679.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 S679.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50							
Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,370,00 Läuft am 21. Dez. 2021 ab Bank of America USD 9.991 10.386 395 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,510,00 Läuft am 8. Nov. 2021 ab Barclays Bank USD 10.659 3.256 (7.403 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 Barclays Bank USD 6.871 4.848 (2.023 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 BNP Paribas USD 7.411 8.860 1.449 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 S80.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 SAUSÜNR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 SAUSÜNR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 SAUSÜNR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 SAUSÜNR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 SAUSÜNR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 SAUSÜNR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	2.376.000		Barclays Bank	USD	24.116	54.879	30.763
Eauft am 21. Dez. 2021 ab Bank of America USD 9.991 10.386 395			,				
Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,510,00 567,000 Läuft am 8. Nov. 2021 ab Barclays Bank USD 10,659 3.256 (7.403 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 397,000 Läuft am 6. Dez. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 678,000 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Barclays Bank OSD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	671 000		Pank of America	LICD	0.001	10 396	205
Ausübungskurs 14.510,00 Läuft am 8. Nov. 2021 ab Barclays Bank USD 10.659 3.256 (7.403 Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.773,00 297.000 Läuft am 6. Dez. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 678.000 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 (855.000) Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD (4.897) (6.651) (1.754 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Läuft am 5. Nov. 2021 ab Bank of America USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 Eaft am 10. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	671.000		Bank of America	מצט	9.991	10.386	395
Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,773,00 397.000 Läuft am 6. Dez. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 678.000 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 855.000) Läuft am 6. Okt. 2021 ab Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 855.000) Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 667.000 Läuft am 5. Nov. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 580.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 679.000 Läuft am 10. Nez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,544 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50 Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50		Ausübungskurs 14.510,00					
Ausübungskurs 14.773,00 Läuft am 6. Dez. 2021 ab Deutsche Bank USD 6.871 4.848 (2.023 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 678.000 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Morgan Stanley USD 7.411 8.860 1.449 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 (855.000) Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD (4.897) (6.651) (1.754 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/INS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 S80.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 S79.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	667.000		Barclays Bank	USD	10.659	3.256	(7.403)
Earft am 6. Dez. 2021 ab Deutsche Bank USD 6.871 4.848 (2.023							
Ausübungskurs 3,20 Läuft am 20. Dez. 2021 ab Morgan Stanley USD 7,411 8,860 1,449 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 (855.000) Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD (4,897) (6,651) (1,754 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 E80.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6,800 9,308 2,508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 E79,000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7,642 731 (6,911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7,642 8,613 2,141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6,472 8,613 2,141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6,472 8,613 2,141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	997.000	Läuft am 6. Dez. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	6.871	4.848	(2.023)
Läuft am 20. Dez. 2021 ab Morgan Stanley USD 7.411 8.860 1.449							
Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,20 (855.000) Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD (4.897) (6.651) (1.754 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21 667.000 Läuft am 5. Nov. 2021 ab Bank of America USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 680.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 679.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	678.000		Morgan Stanley	USD	7.411	8.860	1.449
Läuft am 6. Okt. 2021 ab BNP Paribas USD (4.897) (6.651) (1.754 Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21			,				
Call auf USD/ILS-Devisenkurs	(855 000)		RNP Parihas	LISD	(4 897)	(6.651)	(1 754)
Läuft am 5. Nov. 2021 ab Bank of America USD 7.214 5.803 (1.411 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,19 680.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 679.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	(055.000)		DIVI TUTIOUS	035	(1.037)	(0.031)	(1.731)
Call auf USD/INR-Devisenkurs			5 1 64 1		7044		44.44
Ausübungskurs 74,19 680.000 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Barclays Bank USD 6.800 9.308 2.508 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 679.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	667.000		Bank of America	USD	7.214	5.803	(1.411)
Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44 679.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50							
Ausübungskurs 75,44 679.000 Läuft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	680.000		Barclays Bank	USD	6.800	9.308	2.508
Eauft am 21. Okt. 2021 ab Barclays Bank USD 7.642 731 (6.911 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50							
Ausübungskurs 75,84 1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	679.000		Barclays Bank	USD	7.642	731	(6.911)
1.537.000 Läuft am 23. Dez. 2021 ab Bank of America USD 6.472 8.613 2.141 Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50							
Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,50	1.537.000		Bank of America	USD	6.472	8 613	2.141
			Bank of America	035	J. 17 Z	0.013	۷.۱-۲۱
1./38 (4.633 בארו עבער במעונ מוזו זיז, ואטע. בעברו מט שמרכומאָז Barciays Bank איז לאל. 1./38 נייט בארנייט ב	1 201 000		Davidave David	LICD	C 274	4 720	(4.633)
	1.391.000	Lauit aiii 15. NOV. 2021 AD	Barciays Bank	บรบ	6.3/1	1./38	(4.633)

Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA W	ellington Pagosa (Forts.)					
	Call auf USD/JPY-Devisenkurs					
1.262.000	Ausübungskurs 109,84 Läuft am 26. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	13.945	21.533	7.588
	Call auf USD/JPY-Devisenkurs	3 ,				
1.101.000	Ausübungskurs 109,93 Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Citi Bank	USD	13.559	13.999	440
1.101.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs	Citi Darik	030	13.333	13.333	440
(0.42.000)	Ausübungskurs 111,30	Danis of Amarica	LICD	(F F22)	(5.100)	422
(843.000)	Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/JPY-Devisenkurs	Bank of America	USD	(5.522)	(5.100)	422
	Ausübungskurs 95,99					
800.000	Läuft am 17. Juni 2024 ab Call auf USD/KRW-Devisenkurs	BNP Paribas	USD	55.269	102.566	47.297
	Ausübungskurs 1.167,20					
854.000	Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	6.888	12.966	6.078
	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,97					
851.000	Läuft am 14. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	7.991	29.218	21.227
	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,12					
834.000	Läuft am 22. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	9.349	24.804	15.455
	Call auf USD/MXN-Devisenkurs					
1.911.000	Ausübungskurs 20,41 Läuft am 27. Okt. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	21.615	38.151	16.536
	Call auf USD/MXN-Devisenkurs					
1.700.000	Ausübungskurs 20,60 Läuft am 2. Dez. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	37.774	39.590	1.816
σσισσσ	Call auf USD/PHP-Devisenkurs	ga s.a	002	37.77	23.330	
680.000	Ausübungskurs 50,29 Läuft am 9. Dez. 2021 ab	Parelays Pank	USD	7.303	17.389	10.086
080.000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs	Barclays Bank	030	7.303	17.369	10.080
677.000	Ausübungskurs 50,95	Mauren Chamles	HCD	7.762	F 720	(2,022)
677.000	Läuft am 21. Okt. 2021 ab Call auf USD/PHP-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	7.762	5.729	(2.033)
	Ausübungskurs 51,50					
1.531.000	Läuft am 26. Nov. 2021 ab Call auf USD/RUB-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	7.533	12.843	5.310
	Ausübungskurs 73,13					
(834.000)	Läuft am 22. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(9.441)	(6.791)	2.650
	Call auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 74,95					
1.700.000	Läuft am 2. Dez. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	38.343	16.012	(22.331)
	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 8,54					
740.000	Läuft am 5. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	11.781	18.734	6.953
	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 8,73					
727.000	Läuft am 17. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	11.719	9.262	(2.457)
	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35					
888.000	Läuft am 26. Nov. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	7.197	7.804	607
	Call auf USD/SGD-Devisenkurs					
904.000	Ausübungskurs 1,35 Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	7.331	4.606	(2.725)
	Call auf USD/THB-Devisenkurs					(/
677.000	Ausübungskurs 32,72 Läuft am 14. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	8.138	22.812	14.674
577.000	Call auf USD/THB-Devisenkurs	Bar clay 5 Barric	000	0.130	22.012	17.077
(851 000)	Ausübungskurs 32,91	Margan Stanley	USD	(6.242)	(22.050)	(17 71 1)
(851.000)	Läuft am 14. Okt. 2021 ab Call auf USD/TRY-Devisenkurs	Morgan Stanley	טפט	(6.242)	(23.956)	(17.714)
0.42.000	Ausübungskurs 8,80		LICD	45.000	04.44=	6.076
843.000	Läuft am 20. Okt. 2021 ab Call auf USD/TRY-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	15.039	21.115	6.076
	Ausübungskurs 9,63					
1.229.000	Läuft am 17. Dez. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	18.768	23.811	5.043

Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wo	ellington Pagosa (Forts.)					
	Call auf USD/TWD-Devisenkurs					
787.000	Ausübungskurs 27,64 Läuft am 4. Jan. 2022 ab Call auf USD/TWD-Devisenkurs	J.P. Morgan	USD	7.319	6.881	(438)
843.000	Ausübungskurs 27,75 Läuft am 27. Okt. 2021 ab Call auf USD/ZAR-Devisenkurs	J.P. Morgan	USD	3.368	3.014	(354)
(852.000)	Ausübungskurs 14,20 Läuft am 12. Okt. 2021 ab Call auf USD/ZAR-Devisenkurs	Bank of America	USD	(13.836)	(49.432)	(35.596)
(854.000)	Ausübungskurs 14,44 Läuft am 5. Okt. 2021 ab Call auf USD/ZAR-Devisenkurs	Barclays Bank	USD	(14.757)	(35.078)	(20.321)
705.000	Ausübungskurs 15,81 Läuft am 14. Okt. 2021 ab Call auf USD/ZAR-Devisenkurs	Citi Bank	USD	9.592	1.338	(8.254)
2.452.000	Ausübungskurs 17,09 Läuft am 22. Feb. 2022 ab Call auf FTSE 100 Index	Citi Bank	USD	46.343	29.642	(16.701)
244	Ausübungskurs 7.175,00 Läuft am 15. Okt. 2021 ab Call auf FTSE 100 Index	Goldman Sachs	GBP	21.005	14.615	(6.390)
214	Ausübungskurs 7.325,00 Läuft am 17. Dez. 2021 ab Call auf Global Payments, Inc.	Goldman Sachs	GBP	22.362	23.688	1.326
50	Ausübungskurs 185,00 Läuft am 19. Nov. 2021 ab Call auf Global Payments, Inc.	Morgan Stanley	USD	31.166	4.625	(26.541)
(50)	Ausübungskurs 220,00 Läuft am 19. Nov. 2021 ab Call auf KOSPI 200 Index	Morgan Stanley	USD	(3.934)	(875)	3.059
4.095.620	Ausübungskurs 452,74 Läuft am 14. Okt. 2021 ab Call auf S&P Biotechnology Select	Morgan Stanley	KRW	10.253	1	(10.252)
(105)	Industry Index Ausübungskurs 11.721,00 Läuft am 21. Jan. 2022 ab Call auf Standard Chartered PLC	Barclays Bank	USD	(22.470)	(3.090)	19.380
95.193	Ausübungskurs 5,30 Läuft am 17. Dez. 2021 ab Call auf Standard Chartered PLC	J.P. Morgan	GBP	9.239	2.634	(6.605)
98.535	Ausübungskurs 5,35 Läuft am 17. Dez. 2021 ab Call auf TOPIX Banks Index	J.P. Morgan	GBP	9.491	2.431	(7.060)
2.781.916	Ausübungskurs 165,01 Läuft am 10. Dez. 2021 ab Call auf UniCredit SpA	J.P. Morgan	JPY	60.590	36.041	(24.549)
103.310	Ausübungskurs 12,00 Läuft am 17. Dez. 2021 ab Put auf Commerzbank AG	Goldman Sachs	EUR	73.143	67.966	(5.177)
(136.000)	Ausübungskurs 4,40 Läuft am 18. Mrz. 2022 ab Put auf Facebook, Inc.	Goldman Sachs	EUR	(20.364)	(22.758)	(2.394)
(26)	Ausübungskurs 300,00 Läuft am 29. Okt. 2021 ab Put auf Facebook, Inc.	Morgan Stanley	USD	(6.753)	(9.490)	(2.737)
26	Ausübungskurs 335,00 Läuft am 29. Okt. 2021 ab Put auf Financial Select Sector SPDR Fund	Morgan Stanley	USD	22.897	31.720	8.823
(6.750)	Ausübungskurs 370,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab Put auf Financial Select Sector SPDR Fund	Morgan Stanley	USD	(85.278)	(82.381)	2.897
(5.136)	Ausübungskurs 370,00 Läuft am 19. Nov. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(6.574)	(6.462)	112

Call oder Put zugrunde liegen der Nennwert	ı- Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA V	Vellington Pagosa (Forts.)					
	Put auf Financial Select Sector SPDR Fund Ausübungskurs 383,00					
(3.850)	Läuft am 17. Dez. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(10.010)	(15.768)	(5.758)
	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 81,12					
(1.155.000)	Läuft am 12. Okt. 2021 ab	Citi Bank	AUD	(8.554)	(9.800)	(1.246)
	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs					
(1.155.000)	Ausübungskurs 81,58 Läuft am 5. Okt. 2021 ab	BNP Paribas	AUD	(8.736)	(12.028)	(3.292)
	Put auf AUD/USD-Devisenkurs					
3.355.000	Ausübungskurs 0,71 Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	AUD	19.726	6.686	(13.040)
	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs	3				, ,
961.000	Ausübungskurs 1,60 Läuft am 13. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	8.830	5.721	(3.109)
	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs					(=::==,
959.000	Ausübungskurs 1,61 Läuft am 27. Okt. 2021 ab	Bank of America	EUR	8.803	10.127	1.324
333.000	Put auf EUR/BRL-Devisenkurs	24 317		0.000		
(713.000)	Ausübungskurs 6,29 Läuft am 26. Okt. 2021 ab	Bank of America	EUR	(15.491)	(11.103)	4.388
(7.13.33)	Put auf EUR/BRL-Devisenkurs	Dank or 7 kmerica		(151.151)	(111103)	
(720.000)	Ausübungskurs 6,29 Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	(15.796)	(5.980)	9.816
(720.000)	Put auf EUR/CNH-Devisenkurs	worgan starney	LOIK	(13.730)	(3.300)	3.010
721.000	Ausübungskurs 7,64 Läuft am 12. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	4.335	18.477	14.142
721.000	Put auf EUR/CNH-Devisenkurs	Citi Barik	LOIK	4.555	10.477	17,172
721.000	Ausübungskurs 7,67 Läuft am 5. Okt. 2021 ab	Deutsche Bank	EUR	4.606	22.376	17.770
721.000	Put auf EUR/JPY-Devisenkurs	Deatselle Ballik	LOIK	1.000	22.370	17.773
1.078.000	Ausübungskurs 128,50 Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	8.535	4.814	(3.721)
1.070.000	Put auf EUR/MXN-Devisenkurs	Citi Barik	LOIK	0.555	4.014	(3.721)
713.000	Ausübungskurs 23,65 Läuft am 26. Okt. 2021 ab	Bank of America	EUR	8.264	3.364	(4.900)
713.000	Put auf EUR/MXN-Devisenkurs	Dank of America	LOIK	0.204	3.304	(4.500)
720.000	Ausübungskurs 23,68 Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	7.853	1.537	(6.316)
720.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs	Morgan Starliey	LOK	7.055	1.557	(0.510)
840.000	Ausübungskurs 1,66 Läuft am 13. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	8.655	1.682	(6.973)
040.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs	CIU Dalik	LOIK	0.055	1.002	(0.573)
838.000	Ausübungskurs 1,67 Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	8.966	4.703	(4.263)
030.000	Put auf EUR/SEK-Devisenkurs	Citi Barik	LOIK	0.500	4.703	(4.203)
730.000	Ausübungskurs 10,20 Läuft am 28. Okt. 2021 ab	Bank of America	EUR	4.460	7.025	2.565
750.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs	Barik of America	LOIK	4.400	7.023	2.303
1.030.000	Ausübungskurs 1,15 Läuft am 14. Feb. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	7.121	9.729	2.608
1.030.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs	Worgan Starticy	LOIK	7.121	5.725	2.000
2.116.000	Ausübungskurs 1,15 Läuft am 6. Jan. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	10.549	15.281	4.732
2.110.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs	dolaman sachs	LOIK	10.545	13.201	4.752
3.272.000	Ausübungskurs 1,16 Läuft am 6. Jan. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	42.452	40.360	(2.092)
3.272.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs	Goldman Sachs	LOIK	72.732	40.500	(2.032)
1.198.000	Ausübungskurs 1,17 Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	EUR	8.639	16.870	8.231
1.150.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs	Darciays Darik	LUK	0.033	10.070	0,231
3.228.000	Ausübungskurs 1,17 Läuft am 21. Okt. 2021 ab	Citi Bank	EUR	21.589	50.539	28.950
5.220.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs	CIU DAIIK	LUK	۲۱.۵۵۶	30.539	20.930
3.645.000	Ausübungskurs 1,17 Läuft am 21. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	25.257	54.587	29.330
3.043.000	Laurt airi 21. Okt. 2021 db	worgan stanley	LUK	23.231	34.30/	23.330

Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA W	ellington Pagosa (Forts.)					
	Put auf EUR/USD-Devisenkurs					
1.074.000	Ausübungskurs 1,18 Läuft am 16. Nov. 2021 ab	Bank of America	EUR	13.705	24.154	10.449
1.074.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs	Burne of Authorited	LOIC	13.703	24.134	10.443
	Ausübungskurs 1,19					
1.028.000	Läuft am 31. Jan. 2022 ab Put auf EUR/USD-Devisenkurs	BNP Paribas	EUR	19.267	36.368	17.101
	Ausübungskurs 1,19					
1.089.000	Läuft am 4. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	EUR	14.935	29.490	14.555
	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,19					
1.202.000	Läuft am 6. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	EUR	8.398	34.663	26.265
	Put auf EUR/ZAR-Devisenkurs	·				
(730.000)	Ausübungskurs 17,70 Läuft am 28. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	(14.118)	(19.137)	(5.019)
(730.000)	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs	Worgan Stanley	LOI	(14.110)	(15.157)	(5.015)
024 000	Ausübungskurs 1,88	D (A '	CDD	0.265	44345	5.050
821.000	Läuft am 27. Okt. 2021 ab Put auf GBP/JPY-Devisenkurs	Bank of America	GBP	8.365	14.315	5.950
	Ausübungskurs 152,08					
720.000	Läuft am 6. Okt. 2021 ab	Deutsche Bank	GBP	8.140	14.028	5.888
	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,31					
1.298.000	Läuft am 29. Mrz. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	15.344	17.791	2.447
	Put auf GBP/USD-Devisenkurs					
889.000	Ausübungskurs 1,34 Läuft am 20. Dez. 2021 ab	Citi Bank	GBP	7.049	12.250	5.201
	Put auf GBP/USD-Devisenkurs					
2.434.000	Ausübungskurs 1,37 Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Citi Bank	GBP	25.437	53.330	27.893
2.434.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs	Citi Balik	GBF	23.437	33.330	27.693
	Ausübungskurs 1,37					
2.085.000	Läuft am 21. Okt. 2021 ab Put auf GBP/USD-Devisenkurs	Barclays Bank	GBP	21.488	46.287	24.799
	Ausübungskurs 1,38					
923.000	Läuft am 13. Okt. 2021 ab	Deutsche Bank	GBP	8.955	31.256	22.301
	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,38					
659.000	Läuft am 18. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	GBP	12.378	24.764	12.386
	Put auf GBP/USD-Devisenkurs					
670.000	Ausübungskurs 1,38 Läuft am 3. Dez. 2021 ab	Bank of America	GBP	11.803	26.776	14.973
	Put auf GBP/USD-Devisenkurs					
620.000	Ausübungskurs 1,38 Läuft am 5. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	GBP	6.278	20.859	14.581
020.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs	Worgan Starlley	GBF	0.278	20.839	14.361
	Ausübungskurs 1,39					
926.000	Läuft am 6. Okt. 2021 ab Put auf NZD/USD-Devisenkurs	BNP Paribas	GBP	8.789	34.674	25.885
	Ausübungskurs 0,67					
3.545.000	Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	NZD	19.967	3.250	(16.717)
	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,70					
775.000	Läuft am 15. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	NZD	9.652	13.506	3.854
	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,70					
1.205.000	Läuft am 27. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	NZD	9.128	16.568	7.440
	Put auf NZD/USD-Devisenkurs	,				
(1.205.000)	Ausübungskurs 0,71 Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	NZD	(9.769)	(23.284)	(13.515)
(203.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs	ino gan samey	.120	(5.7.05)	(23.204)	(13.313)
(2.444.000)	Ausübungskurs 5,02	Davitask - David	LICD	(E 4 070)	(26, 420)	20.424
(2.444.000)	Läuft am 12. Jul. 2022 ab Put auf USD/BRL-Devisenkurs	Deutsche Bank	USD	(54.870)	(26.439)	28.431
	Ausübungskurs 5,07					
(1.856.000)	Läuft am 8. Mrz. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	(30.080)	(15.989)	14.091

Call oder Put zugrunde lieger der Nennwert	n- Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA \	Wellington Pagosa (Forts.)					
	Put auf USD/BRL-Devisenkurs					
(2.465.000)	Ausübungskurs 5,09 Läuft am 10. Mrz. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(39.302)	(22.731)	16.571
(2.403.000)	Put auf USD/CAD-Devisenkurs	doluman sacris	030	(39.302)	(22.731)	10.571
	Ausübungskurs 1,24					
(2.476.000)	Läuft am 14. Dez. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	(11.872)	(8.160)	3.712
	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,91					
1.104.000	Läuft am 11. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	13.855	266	(13.589)
	Put auf USD/CHF-Devisenkurs					
1.081.000	Ausübungskurs 0,91 Läuft am 26. Nov. 2021 ab	BNP Paribas	USD	13.480	3.040	(10.440)
	Put auf USD/CLP-Devisenkurs					(,
(4.052.000)	Ausübungskurs 757,90	Citi Davil	HCD	(24.440)	(17.051)	7.050
(1.852.000)	Läuft am 10. Mrz. 2022 ab Put auf USD/CLP-Devisenkurs	Citi Bank	USD	(24.110)	(17.051)	7.059
	Ausübungskurs 767,00					
855.000	Läuft am 6. Okt. 2021 ab	Bank of America	USD	13.285	4	(13.281)
	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 786,70					
(2.428.000)	Läuft am 2. Dez. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	(74.345)	(25.320)	49.025
	Put auf USD/CLP-Devisenkurs					
852.000	Ausübungskurs 791,25 Läuft am 12. Okt. 2021 ab	Bank of America	USD	13.434	1.488	(11.946)
032.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs	Burne of Afficience	030	13.434	1.400	(11.540)
0.474.000	Ausübungskurs 6,41			44.050	40.445	(4.5.47)
2.471.000	Läuft am 11. Mrz. 2022 ab Put auf USD/CNH-Devisenkurs	Goldman Sachs	USD	11.962	10.415	(1.547)
	Ausübungskurs 6,50					
(843.000)	Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(4.268)	(6.362)	(2.094)
	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,50					
1.587.000	Läuft am 9. Dez. 2021 ab	Barclays Bank	USD	13.521	13.444	(77)
	Put auf USD/CNH-Devisenkurs					
1.579.000	Ausübungskurs 6,52 Läuft am 21. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	13.958	17.194	3.236
1.575.000	Put auf USD/CZK-Devisenkurs	Darciay3 Darik	030	13.550	17.134	3.230
	Ausübungskurs 21,63					(
670.000	Läuft am 30. Nov. 2021 ab Put auf USD/CZK-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	10.074	4.036	(6.038)
	Ausübungskurs 21,81					
679.000	Läuft am 11. Okt. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	11.000	2.401	(8.599)
	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.370,00					
671.000	Läuft am 21. Dez. 2021 ab	Bank of America	USD	9.991	6.972	(3.019)
	Put auf USD/IDR-Devisenkurs					
667.000	Ausübungskurs 14.510,00 Läuft am 8. Nov. 2021 ab	Barclays Bank	USD	10.659	9.682	(977)
007.000	Put auf USD/ILS-Devisenkurs	Darciays Darik	030	10.059	9.002	(377)
	Ausübungskurs 3,20					
678.000	Läuft am 20. Dez. 2021 ab Put auf USD/ILS-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	7.411	4.726	(2.685)
	Ausübungskurs 3,20					
(855.000)	Läuft am 6. Okt. 2021 ab	BNP Paribas	USD	(4.897)	(258)	4.639
	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,21					
667.000	Läuft am 5. Nov. 2021 ab	Bank of America	USD	7.214	2.760	(4.454)
	Put auf USD/INR-Devisenkurs					. ,
2.484.000	Ausübungskurs 72,95 Läuft am 7. Dez. 2021 ab	Citi Bank	USD	9.191	3.170	<i>(6</i> 021)
۷. ۲ ۵4,000	Put auf USD/INR-Devisenkurs	CIU Dalik	טטט	5.151	3.170	(6.021)
	Ausübungskurs 74,19					
680.000	Läuft am 10. Dez. 2021 ab	Barclays Bank	USD	6.800	3.334	(3.466)
	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,44					
679.000	Läuft am 21. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	7.642	9.918	2.276

Call oder Put zugrunde liege der Nennwert		Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA	Wellington Pagosa (Forts.)					
	Put auf USD/JPY-Devisenkurs					
1.262.000	Ausübungskurs 109,84 Läuft am 26. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	13.945	5.332	(8.613)
0000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs	o. ga o.aoj	002	.5.5 .5	3.332	(3.3.3)
1 205 000	Ausübungskurs 109,86	Managa Charley	HCD	0.527		(0.527)
1.395.000	Läuft am 30. Sept. 2021 ab Put auf USD/JPY-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	8.537	_	(8.537)
	Ausübungskurs 109,93					
1.101.000	Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Citi Bank	USD	13.559	396	(13.163)
	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 111,30					
(843.000)	Läuft am 27. Okt. 2021 ab	Bank of America	USD	(5.522)	(5.160)	362
	Put auf USD/JPY-Devisenkurs					
800.000	Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Juni 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	8.906	(46.363)
	Put auf USD/KRW-Devisenkurs					(12.2.22)
((0,000	Ausübungskurs 1.130,00	Margan Ctaplay	LICD	0.774		(0.774)
669.000	Läuft am 30. Sept. 2021 ab Put auf USD/KRW-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	8.774	-	(8.774)
	Ausübungskurs 1.167,20					
854.000	Läuft am 8. Okt. 2021 ab Put auf USD/MXN-Devisenkurs	Barclays Bank	USD	6.888	263	(6.625)
	Ausübungskurs 19,50					
2.471.000	Läuft am 11. Mrz. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	24.176	8.717	(15.459)
	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,55					
2.476.000	Läuft am 15. Dez. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	16.317	3.291	(13.026)
	Put auf USD/MXN-Devisenkurs					
1.204.000	Ausübungskurs 19,67 Läuft am 9. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	8.840	699	(8.141)
0000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs	o. ga o.aoj	002	0.0.0	033	(6)
851.000	Ausübungskurs 19,97	Margan Stanlay	USD	7.991	273	(7.710)
651.000	Läuft am 14. Okt. 2021 ab Put auf USD/MXN-Devisenkurs	Morgan Stanley	טאט	7.991	2/3	(7.718)
	Ausübungskurs 20,12					
834.000	Läuft am 22. Okt. 2021 ab Put auf USD/MXN-Devisenkurs	Morgan Stanley	USD	9.349	1.157	(8.192)
	Ausübungskurs 20,17					
1.235.000	Läuft am 6. Jan. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	9.727	9.104	(623)
	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,60					
1.700.000	Läuft am 2. Dez. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	37.774	21.451	(16.323)
	Put auf USD/PHP-Devisenkurs					
680.000	Ausübungskurs 50,29 Läuft am 9. Dez. 2021 ab	Barclays Bank	USD	7.303	1.296	(6.007)
	Put auf USD/PHP-Devisenkurs					,
677.000	Ausübungskurs 50,95 Läuft am 21. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	7.762	2.282	(5.480)
677.000	Put auf USD/RUB-Devisenkurs	Worgan Starliey	03D	7.702	2.202	(3.480)
	Ausübungskurs 72,14					
2.427.000	Läuft am 28. Feb. 2022 ab Put auf USD/RUB-Devisenkurs	Citi Bank	USD	25.423	26.016	593
	Ausübungskurs 72,25					
1.216.000	Läuft am 26. Jan. 2022 ab	Citi Bank	USD	14.002	12.314	(1.688)
	Put auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 73,13					
(834.000)	Läuft am 22. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(9.441)	(8.573)	868
	Put auf USD/RUB-Devisenkurs					
1.700.000	Ausübungskurs 74,95 Läuft am 2. Dez. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	36.305	50.179	13.874
	Put auf USD/SEK-Devisenkurs					
740.000	Ausübungskurs 8,54 Läuft am 5. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	11.781	5	(11.776)
. 10.000	Put auf USD/SEK-Devisenkurs	worgan stanley	000		5	(11.770)
727 000	Ausübungskurs 8,73	Margan Ct.	LICD	14 740	7.045	(4 (7 4)
727.000	Läuft am 17. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	11.719	7.045	(4.674)

Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA W	ellington Pagosa (Forts.)					
	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35					
888.000	Läuft am 26. Nov. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	7.197	3.575	(3.622)
	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35					
904.000	Läuft am 8. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	7.331	599	(6.732)
	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 32,72					
677.000	Läuft am 14. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	8.138	37	(8.101)
	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 32,91					
(851.000)	Läuft am 14. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(6.242)	(103)	6.139
	Put auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 8,57					
(1.229.000)	Läuft am 17. Dez. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(12.182)	(4.818)	7.364
	Put auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 8,79					
(1.823.000)	Läuft am 17. Dez. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(17.783)	(15.309)	2.474
	Put auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 8,80					
843.000	Läuft am 20. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	15.039	4.337	(10.702)
	Put auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 27,64					
787.000	Läuft am 4. Jan. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	7.319	7.091	(228)
	Put auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 27,75					
843.000	Läuft am 27. Okt. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	3.368	3.083	(285)
	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,20					
(852.000)	Läuft am 12. Okt. 2021 ab	Bank of America	USD	(13.836)	(198)	13.638
	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,44					
(854.000)	Läuft am 5. Okt. 2021 ab	Barclays Bank	USD	(14.757)	(43)	14.714
	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,67					
(2.452.000)	Läuft am 22. Feb. 2022 ab	Citi Bank	USD	(35.915)	(46.853)	(10.938)
	Put auf Global Payments, Inc.					
(37)	Ausübungskurs 145,00 Läuft am 19. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(12.202)	(11.655)	547
	Put auf International Monetary Market					
	Eurodollars Options - Futures Ausübungskurs 99,25					
71	Läuft am 13. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	32.516	28.400	(4.116)
	Put auf International Monetary Market Eurodollars Options - Futures					
227	Ausübungskurs 99,50 Läuft am 19. Sept. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	32.389	26.956	(5.433)
227	Put auf MSCI EAFE Index	Worgan Starliey	030	32.369	20.930	(3.433)
(20)	Ausübungskurs 2.050,00 Läuft am 15. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(14.398)	(9.000)	5.398
(20)	Put auf MSCI EAFE Index	Morgan Stanley	טטט	(14.596)	(9.000)	5.396
20	Ausübungskurs 2.275,00	Margan Stanlov	LICD	EE 206	70,000	14.714
20	Läuft am 15. Okt. 2021 ab Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index	Morgan Stanley	USD	55.286	70.000	14.714
(0)	Ausübungskurs 2.550,00	Morgan Stanloy	LICD	(10 100)	(10.205)	(1.215)
(9)	Läuft am 19. Nov. 2021 ab Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index	Morgan Stanley	USD	(18.180)	(19.395)	(1.215)
(11)	Ausübungskurs 2.675,00 Läuft am 15. Okt. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(16 620)	(7.865)	8.763
(11)	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index	wioi gair stailley	טטט	(16.628)	(7.005)	0./03
6	Ausübungskurs 2.910,00	Morgan Stanlay	IICD	24 060	E3 EE0	10 600
6	Läuft am 19. Nov. 2021 ab Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index	Morgan Stanley	USD	34.868	53.550	18.682
0	Ausübungskurs 2.915,00	Morgan Chanley	LICD	70 275	01 045	11 670
9	Läuft am 19. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	70.275	81.945	11.670

Call oder Put zugrunde liegen- der Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA W	ellington Pagosa (Forts.) Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index					
11	Ausübungskurs 2.975,00 Läuft am 15. Okt. 2021 ab Put auf Russell 2000 Index	Morgan Stanley	USD	54.355	77.385	23.030
(32)	Ausübungskurs 1.980,00 Läuft am 19. Nov. 2021 ab Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 2.210,00	Morgan Stanley	USD	(70.626)	(80.160)	(9.534)
32	Läuft am 19. Nov. 2021 ab Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.700,00	Morgan Stanley	USD	202.772	269.280	66.508
(7)	Läuft am 19. Nov. 2021 ab Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.850,00	Morgan Stanley	USD	(15.027)	(14.280)	747
(8)	Läuft am 30. Sept. 2021 ab Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.000,00	Morgan Stanley	USD	(9.853)	(40)	9.813
(29)	Läuft am 29. Okt. 2021 ab Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.200,00	Morgan Stanley	USD	(59.143)	(82.215)	(23.072)
4	Läuft am 19. Nov. 2021 ab Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.300,00	Morgan Stanley	USD	27.253	35.880	8.627
7	Läuft am 19. Nov. 2021 ab Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.325,00	Morgan Stanley	USD	59.453	83.755	24.302
29	Läuft am 29. Okt. 2021 ab Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.350,00	Morgan Stanley	USD	194.381	292.465	98.084
8	Läuft am 30. Sept. 2021 ab Put auf S&P Biotechnology Select Industry Index	Morgan Stanley	USD	46.727	31.120	(15.607)
105	Ausübungskurs 9.280,00 Läuft am 21. Jan. 2022 ab	Barclays Bank	USD	62.370	33.350	(29.020)
				USD	2.855.861	(33.838)

Swaptions

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

Zum 30. September 2021 wiesen die folgenden Teilfonds offene Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Schutz-						Markt-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	wert	(Wertverlust)
	AIA Wellington Pagosa						
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 1,50 % Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR Jul 2023", Put, 1,50 %, 19. Juli 2023	Bank of America	USD	355.559	9.795.000	541.284	185.725
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 7,69 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026", Put, 7,69 %, 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	222.640	(161.484)
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 8,50 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028", Put, 8,50 %, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	45.932	(49.993)
Verkauf	IRS "Erhält Festzinssatz 4,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2022", Call, 4,80 %,	J.P. Morgan	MXN	(14.729)	(273.960.000)	(82)	14.647
Verkauf	26. Apr. 2022 IRS "Erhält Festzinssatz 4,86 % Zahlt variablen Zinssatz MXN	J.P. Morgan	MXN	(27.657)	(547.915.000)	(114)	27.543
	TIIE Mar 2022", Call, 4,86 %, 23. Mrz. 2022						
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 5,30 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2022", Call, 5,30 %, 26. Apr. 2022	J.P. Morgan	MXN	49.542	273.960.000	428	(49.114)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 5,36 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2022", Call, 5,36 %, 23. Mrz. 2022	J.P. Morgan	MXN	86.920	547.915.000	795	(86.125)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 5,97 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2023", Call, 5,97 %, 30. Mrz. 2023	J.P. Morgan	MXN	69.383	46.495.000	2.627	(66.756)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 6,25 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2022", Call, 6,25 %, 21. Feb. 2022	J.P. Morgan	MXN	67.565	67.710.000	1.824	(65.741)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	93.533	(448.143)
	TIIE Feb 2025", Call, 6,80 %, 7. Feb. 2025						
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,08 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Nov 2021", Call, 7,08 %, 8. Nov. 2021	J.P. Morgan	ZAR	156.324	84.425.000	893	(155.431)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026", Call, 7,29 %, 5. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	114.656	(281.868)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 8,50 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028", Call, 8,50 %, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	41.343	(54.582)
	5.71p1.2020					USD 1.065.759	(1.191.322)

Total Return Swap-Kontrakte

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

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

Zum 30. September 2021 waren folgende Teilfonds in Total Return Swaps-Vereinbarungen engagiert:

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA	Egerton Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	16.542.537	10.813.613	3. Dez. 2021	12.462.433
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	34.027.867	(470.858)	21. Jan. 2022	2.630.680
Kauf Long	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	3.701.913	376.542	6. Mai 2022	1.049.294
Kauf Long	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	17.787.883	7.454.222	27. Dez. 2021	7.548.604
Kauf Long	Banken	UBS	EUR	2.976.416	87.896	30. Apr. 2024	87.896
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	25.831.529	(4.511.771)	7. Aug. 2024	(4.511.771)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	GBP	8.375.076	1.174.518	8. Dez. 2021	1.348.484
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	26.591.360	809.505	7. Aug. 2024	825.201
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	14.992.496	(1.895.523)	18. Jun. 2024	(1.895.523)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	2.491.374	(271.860)	24. Jul. 2024	(272.885)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	6.992.571	455.200	25. Feb. 2022	(78.327)
Verkauf Short	Bekleidung	Merrill Lynch	USD	1.806.869	121.273	31. Okt. 2022	121.273
Verkauf Short	Automobilhersteller	Merrill Lynch	USD	1.754.421	(663.648)	31. Okt. 2022	(547.053)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	EUR	1.915.749	293.420	18. Sept. 2024	293.418
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	1.959.959	61.012	3. Dez. 2021	61.217
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	HKD	2.491.026	(105.473)	23. Dez. 2022	(105.473)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	923.774	(27.517)	24. Okt. 2022	(27.618)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	EUR	1.952.190	(20.665)	18. Sept. 2024	(20.665)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	EUR	2.050.038	107.424	3. Dez. 2021	129.818
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	990.877	(1.241.274)	26. Apr. 2023	(1.263.481)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	DKK	3.746.328	259.372	13. Feb. 2024	258.855
Verkauf Short	Chemie	J.P. Morgan	USD	5.417.971	(65.770)	9. Mrz. 2022	(68.614)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	3.284.365	215.252	31. Okt. 2022	251.189
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	1.481.628	165.398	11. Sept. 2024	165.398
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	6.233.250	(298.936)	14. Jun. 2023	(529.832)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	EUR	3.697.252	284.588	3. Dez. 2021	404.819
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	8.501.339	(369.824)	24. Okt. 2022	(796.799)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	USD	3.506.456	168.039	25. Sept. 2023	168.039
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	DKK	5.615.457	688.570	4. Apr. 2024	689.188
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	3.180.575	665.476	5. Mrz. 2024	669.676
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	868.186	236.871	28. Feb. 2024	237.002
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	1.958.000	12.680	31. Okt. 2022	12.680
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	DKK	3.057.020	(260.558)	24. Apr. 2024	(255.574)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	935.850	309.892	10. Jul. 2024	311.509
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	2.814.618	221.506	13. Jul. 2022	191.461
Verkauf Short	Unterhaltung	Merrill Lynch	USD	2.006.929	92.843	31. Okt. 2022	8.734
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	5.793.022	673.452	16. Jan. 2024	595.087
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	3.974.122	618.053	21. Mrz. 2024	746.869
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2.940.613	(260.271)	28. Aug. 2024	(260.271)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
•	Egerton Equity (Forts.)						,
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	1.912.570	(15.324)	17. Sept. 2024	(15.324
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	203.247	1.155	2. Okt. 2024	1.155
Verkauf Short		Morgan Stanley	GBP	996.242	28.734	8. Dez. 2021	32.335
	Lebensmitteldienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.926.153	145.751	24. Jul. 2024	146.166
Verkauf Short	•	Morgan Stanley	HKD	6.275.734	223.214	23. Dez. 2022	240.902
	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	4.773.140	738.476	15. Mai 2024	748.47
	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	3.022.973	56.494	26. Apr. 2023	32.049
	Gesundheitswesen - Produkte	Merrill Lynch	USD	4.993.476	765.485	31. Okt. 2022	786.553
	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	3.653.950	364.382	31. Okt. 2022	359.87
	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	5.458.822	164.444	31. Jul. 2024	174.238
	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	3.030.994	784.023	31. Okt. 2022	795.006
Verkauf Short	•	Goldman Sachs	USD	1.887.748	153.577	7. Feb. 2024	380.114
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	2.670.300	1.859.257	7. Mrz. 2024	1.878.059
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	5.265.860	268.530	13. Sept. 2022	270.786
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	2.465.422	106.641	20. Okt. 2022	106.64
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	6.532.810	274.932	24. Okt. 2022	274.93
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	EUR	3.367.818	27.344	26. Sept. 2024	27.34
	Maschinen - Bau u. Bergbau	Morgan Stanley	USD	973.683	273.360	13. Jul. 2022	273.67
	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	CHF	3.508.421	56.151	24. Jul. 2024	56.50
	Diverse Fertigungsbetriebe	Merrill Lynch	USD	2.966.788	413.943	31. Okt. 2022	414.46
	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	3.833.361	747.012	3. Dez. 2021	742.40
	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley		3.736.494	(86.890)	24. Okt. 2022	(87.00
	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	3.568.989	(360.692)	8. Dez. 2021	(418.01)
	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	2.549.419	(134.725)	31. Okt. 2022	(134.72
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	3.853.816	106.739	25. Sept. 2023	106.73
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	3.939.155	774.777	31. Okt. 2022	773.11
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	EUR	937.514	(249.316)	3. Dez. 2021	(220.05
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	2.456.304	117.532	21. Aug. 2024	117.53
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	944.983	102.662	5. Sept. 2024	103.32
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	10.774.595	381.182	31. Mai 2022	428.45
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1.526.234	199.465	31. Okt. 2022	199.24
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	1.991.725	68.711	25. Sept. 2024	68.71
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	3.650.839	854.138	28. Feb. 2024	861.34
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	3.178.543	(187.868)	22. Feb. 2024	(181.25
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	2.013.844	598.497	29. Jul. 2022	250.24
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	5.921.209	155.861	31. Okt. 2022	155.86
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	7.737.175	(1.377.953)	31. Okt. 2022	(1.362.30
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	PLN	3.786.389	203.913	13. Jul. 2022	478.41
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	9.782.589	751.376	2. Okt. 2023	766.80
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	4.901.821	318.545	26. Jun. 2024	318.54
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	26.340.083	757.920	17. Mai 2023	971.75
		. 3				EUR	31.558.01
Schroder GAIA	Helix						
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	151.311.884	1.335.348	6. Sept. 2022	1.335.34
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	35.412.099	1.026.456	30. Sept. 2021	1.026.45
Verkauf Short		Goldman Sachs	GBP	18.214.671	(48.024)	6. Sept. 2022	(48.02
Verkauf Short		Goldman Sachs		147.381.765	636.553	6. Sept. 2022	636.55
Verkauf Short		Goldman Sachs	-	3.502.279	(52.497)	30. Sept. 2021	(52.49
	, accommod	Joidinan Jacits	J	3.302.213		•	
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	567.132.151	5.289.221	6. Sept. 2022	5.141.06

 $[\]star$ Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien gehalten.



Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA	A Helix (Forts.)						
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	94.849.123	152.617	6. Sept. 2022	152.617
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	124.460.784	1.657.460	30. Sept. 2021	1.657.460
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	466.611.237	2.110.462	6. Sept. 2022	2.110.462
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	299.629.091	1.185.729	30. Sept. 2021	1.185.729
						USD	28.015.261
Schrodor GAIA	A Sirios US Equity						
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	1.698.826	47.255	12. Mai 2022	47.255
Kauf Long Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	14.541.856	1.776.414	12. Mai 2022	1.776.414
Kauf Long Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	12.341.186	(1.250.242)	12. Niai 2022 12. Aug. 2022	(1.256.391)
Kauf Long Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	20.665.385	(337.780)	15. Nov. 2022	(344.367)
Kauf Long Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	2.392.270	91.131	15. Nov. 2022 15. Nov. 2022	91.131
Verkauf Short		Credit Suisse	USD		(67.091)	12. Mai 2022	
	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung Agrarwirtschaft		USD	1.414.155 485.076	81.156		(67.091) 81.156
	•	Merrill Lynch		174.515	29.197	12. Sept. 2022 26. Mai 2022	29.197
	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley				12. Mai 2022	121.029
Verkauf Short	3	Credit Suisse	USD	570.821 511.039	121.029		
	Automobilhersteller	Credit Suisse	USD	1.076.431	9.028	12. Mai 2022	9.028
	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD		87.575	14. Feb. 2023	115.947
	Automobilhersteller	Merrill Lynch	USD	177.908	(4.866)	13. Mai 2022	(4.866)
	Automobilhersteller	Merrill Lynch	USD	721.453	(279.798)	14. Jul. 2022	(279.798)
	Automobilhersteller	Morgan Stanley		640.200	(125.826)	26. Mai 2022	(125.826)
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	2.331.149	43.021	12. Aug. 2022	43.555
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	721.512	(28.221)	24. Jan. 2022	(28.221)
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	2.309.070	124.385	23. Mrz. 2022	124.331
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	685.184	64.179	15. Nov. 2022	64.995
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	1.119.699	(27.328)	12. Mai 2023	(27.363)
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	559.393	14.141	19. Aug. 2022	14.141
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	760.365	69.739	13. Mai 2022	69.739
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	952.421	(8.501)	19. Aug. 2022	(8.501)
Verkauf Short	Computer	Credit Suisse	USD	827.604	(60.184)	12. Mai 2022	(59.233)
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	514.273	2.216	27. Okt. 2022	2.216
Verkauf Short	Elektronik	Credit Suisse	USD	1.907.387	211.666	12. Mai 2022	212.201
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs		510.612	82.253	15. Nov. 2022	82.253
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley		22.803.071	753.430	28. Feb. 2022	753.430
Verkauf Short		Morgan Stanley	USD	20.556.504	146.730	7. Apr. 2022	142.586
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	21.542.992	711.117	26. Mai 2022	711.117
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	10.152.997	780.212	25. Jul. 2022	780.212
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	25.850.725	1.253.257	1. Aug. 2022	1.253.257
Verkauf Short		Morgan Stanley	USD	16.809.569	658.692	8. Sept. 2022	658.692
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1.672.933	38.833	14. Feb. 2023	38.917
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	1.396.116	64.374	24. Mrz. 2022	64.374
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	746.550	28.444	29. Apr. 2022	28.444
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	1.670.914	18.185	24. Jun. 2022	18.185
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	521.336	(6.560)	26. Sept. 2022	(6.139)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Merrill Lynch	USD	414.412	49.001	9. Mai 2022	49.001
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Merrill Lynch	USD	1.468.112	39.869	20. Okt. 2022	39.869
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	2.842.986	229.604	26. Apr. 2022	229.604
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	368.778	46.045	9. Mai 2022	46.045

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAI <i>A</i>	A Sirios US Equity (Forts.)			_			
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	942.918	38.890	19. Apr. 2022	38.890
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	410.163	(77.425)	22. Aug. 2022	(77.425
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	1.414.199	277.900	26. Mai 2022	279.50
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Merrill Lynch	USD	1.025.485	22.771	21. Okt. 2022	22.77
	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	1.369.838	15.060	12. Mai 2023	15.060
Verkauf Short	Medien	Credit Suisse	USD	684.600	20.832	12. Mai 2022	20.83
Verkauf Short	Öl u. Gas	Merrill Lynch	USD	989.358	(36.504)	18. Jan. 2022	(36.50
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Credit Suisse	USD	2.024.631	93.857	12. Mai 2022	93.85
	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	1.073.731	32.347	12. Mai 2022	32.34
	Verpackung u. Behälter	Merrill Lynch	USD	516.618	38.072	24. Jun. 2022	38.072
	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	740.486	(45.352)	7. Feb. 2022	(45.352
Verkauf Short		Credit Suisse	USD	833.075	56.747	12. Mai 2022	56.747
Verkauf Short		Morgan Stanley		308.829	42.656	28. Mrz. 2022	42.650
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	3.429.485	118.811	12. Mai 2022	121.02
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	981.275	127.455	25. Mrz. 2022	127.45
Verkauf Short		Morgan Stanley		3.447.919	63.396	26. Mai 2022	63.39
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	929.792	41.693	15. Nov. 2022	38.65
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	1.051.764	172.728	14. Feb. 2023	172.49
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	849.747	(1.933)	14. Feb. 2022	(1.93
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	996.954	135.821	19. Apr. 2022	129.15
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	660.772	(150.225)	15. Jul. 2022	(150.22
Verkauf Short		Merrill Lynch	USD	462.690	14.697	19. Sept. 2022	14.69
	Telekommunikation	Credit Suisse	USD	2.824.655	161.651	12. Mai 2022	162.26
verkaur Short	reiekommunikation	Credit Suisse	03D	2.024.033	101.051	USD	6.648.94 9
Schroder GAIA	A Two Sigma Diversified						
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	788.161.293	(9.790.355)	21. Okt. 2021 USD	(9.790.39
Schroder GAIA	A Wellington Pagosa					030	(9.790.39
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	10.224	188	24. Mai 2023	188
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	47.159	2.407	9. Mai 2023	2.40
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	283.723	(9.645)	24. Mai 2023	(9.64
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	19.999	(1.932)	9. Mai 2023	(1.932
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	GBP	321.983	251	7. Mai 2023	25
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	31.321	(899)	24. Mai 2023	(89
Kauf Long	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	169.420	(13.467)	9. Mai 2023	(13.46
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs		47.670	524	24. Mai 2023	52
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	CZK	7.381	341	24. Mai 2023	34
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.928.303	223.425	24. Mai 2023	223.42
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	GBP	165.605	9.949	24. Mai 2023	9.94
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs		441.058	16.338	24. Mai 2023	16.33
Kauf Long Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	3.657.438	401.861	24. Mai 2023	401.86
ai Loiig	Banken	J.P. Morgan	EUR	174.645	15.838	20. Jul. 2022	15.83
Kauf Long	Barmen	_		546.889	28.191	9. Mai 2023	28.19
_	Banken	I P Morgan					
Kauf Long	Banken Banken	J.P. Morgan	EUR				
Kauf Long Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	127.463	(6.320)	9. Mai 2023	(6.32
Kauf Long Kauf Long Kauf Long Kauf Long Kauf Long		_	GBP USD				(6.32) (35.33) 25.43)

 $[\]star$ Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien gehalten.



Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
•	(A Wellington Pagosa (Forts.)			.			,
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	SEK	1.000.105	31.799	15. Mai 2023	33.142
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	1.545.632	90.174	15. Mai 2023	90.174
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	140.836	3.504	24. Mai 2023	3.504
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	3.592	(387)	24. Mai 2023	(387
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	2.290.628	(42.168)	24. Mai 2023	(42.168
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	343.483	(9.394)	9. Mai 2023	(9.394
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	619.041	(82.928)	9. Mai 2023	(82.928
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	366.325	14.283	15. Mai 2023	14.283
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1.978.619	(67.347)	15. Mai 2023	(67.347
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	22.619	(1.446)	24. Mai 2023	(1.446
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	HKD	21.761	(2.806)	15. Mai 2023	(2.806
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	26.747	(2.715)	15. Mai 2023	(2.715
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	112.448	(334)	24. Mai 2023	(334
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	EUR	606.452	(29.392)	9. Mai 2023	(29.392
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	JPY	230.059	(13.140)	22. Jun. 2022	(13.140
Kauf Long	Chemie	Morgan Stanley	USD	313.454	21.458	25. Sept. 2023	21.458
Kauf Long	Kohle	Goldman Sachs	AUD	205.480	35.893	24. Mai 2023	35.893
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.757.369	(98.563)	24. Mai 2023	(98.563
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	1.019.538	(33.051)	9. Mai 2023	(33.051
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.235.001	(76.000)	9. Mai 2023	(76.000
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	CAD	320.363	(37.474)	15. Mai 2023	(37.474
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	5.965	(215)	15. Mai 2023	(215
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	729.811	(25.594)	15. Mai 2023	(25.594
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	2.188	(52)	25. Mai 2023	(52
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	77.236	(8.475)	15. Mai 2023	(8.475
Kauf Long	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	USD	71.304	(1.805)	15. Mai 2023	(1.805
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	556.790	3.886	24. Mai 2023	3.886
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	3.106.830	66.053	24. Mai 2023	66.053
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.373.412	56.349	9. Mai 2023	56.349
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	846.006	77.207	15. Mai 2023	77.207
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.049.237	11.697	15. Mai 2023	11.697
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	470.688	(10.979)	24. Mai 2023	(10.979
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	747.501	(36.375)	24. Mai 2023	(36.375
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	93.897	(5.438)	9. Mai 2023	(5.438
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	355.904	67.217	20. Okt. 2023	67.217
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	188.689	(9.168)	9. Mai 2023	(9.168
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	7.947	(560)	15. Mai 2023	(560
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	145.055	9.520	25. Mai 2023	9.520
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	EUR	271.253	(18.390)	22. Jun. 2022	(18.390
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley		8.174	(39)	15. Mai 2023	(39
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	588.210	(47.410)	24. Mai 2023	(47.410
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	2.498	(155)	25. Mai 2023	(155
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	628.062	(71.351)	9. Mai 2023	(71.351
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley		240.256	(36.106)	15. Mai 2023	(36.106
Kauf Long	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	284.918	(21.334)	25. Mai 2023	(21.334
Kauf Long	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	NOK	32.278	4.236	9. Mai 2023	4.236
Kauf Long	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	94.125	10.345	15. Mai 2023	10.345

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.) Kauf Long Bau- und Ingenieurswesen Goldman Sachs USD 256.188 19.694 24. Mai 2023 Kauf Long Unterhaltung Goldman Sachs GBP 484.095 (2.591) 24. Mai 2023 Kauf Long Unterhaltung Morgan Stanley USD 4.350 (264) 15. Mai 2023 Kauf Long Aktienindex J.P. Morgan JPY 943.945 (3.436) 2. Mai 2022 Kauf Long Aktienindex Morgan Stanley USD 365.484 (4.006) 15. Mai 2023 Kauf Long Lebensmitteldienstleistungen Morgan Stanley EUR 175.505 17.896 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs EUR 495.142 (19.362) 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs GBP 42.491 (1.126) 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs HKD 4.410 157 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs USD 4.854.957 (198.558) 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs USD 174.535 15.639 25. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs USD 174.535 15.639 25. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs USD 174.535 15.639 25. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan EUR 5.797 (340) 9. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan USD 1.693.334 (92.233) 9. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley CHF 205.683 (17.277) 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley EUR 26.842 (718) 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley GBP 185.412 (4.670) 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley GBP 185.412 (4.670) 15. Mai 2023	19.694 (2.591) (264) (3.436) (4.006) 17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongUnterhaltungGoldman SachsGBP484.095(2.591)24. Mai 2023Kauf LongUnterhaltungMorgan StanleyUSD4.350(264)15. Mai 2023Kauf LongAktienindexJ.P. MorganJPY943.945(3.436)2. Mai 2022Kauf LongAktienindexMorgan StanleyUSD365.484(4.006)15. Mai 2023Kauf LongLebensmitteldienstleistungenMorgan StanleyEUR175.50517.89615. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsEUR495.142(19.362)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsGBP42.491(1.126)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023 <t< th=""><th>(2.591) (264) (3.436) (4.006) 17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)</th></t<>	(2.591) (264) (3.436) (4.006) 17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongUnterhaltungMorgan StanleyUSD4.350(264)15. Mai 2023Kauf LongAktienindexJ.P. MorganJPY943.945(3.436)2. Mai 2022Kauf LongAktienindexMorgan StanleyUSD365.484(4.006)15. Mai 2023Kauf LongLebensmitteldienstleistungenMorgan StanleyEUR175.50517.89615. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsEUR495.142(19.362)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsGBP42.491(1.126)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsHKD4.41015724. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023 </td <td>(264) (3.436) (4.006) 17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)</td>	(264) (3.436) (4.006) 17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongAktienindexJ.P. MorganJPY943.945(3.436)2. Mai 2022Kauf LongAktienindexMorgan StanleyUSD365.484(4.006)15. Mai 2023Kauf LongLebensmitteldienstleistungenMorgan StanleyEUR175.50517.89615. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsEUR495.142(19.362)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsGBP42.491(1.126)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsHKD4.41015724. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023	(3.436) (4.006) 17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongAktienindexMorgan StanleyUSD365.484(4.006)15. Mai 2023Kauf LongLebensmitteldienstleistungenMorgan StanleyEUR175.50517.89615. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsEUR495.142(19.362)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsGBP42.491(1.126)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsHKD4.41015724. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(4.006) 17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf Long Lebensmitteldienstleistungen Morgan Stanley EUR 175.505 17.896 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs EUR 495.142 (19.362) 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs GBP 42.491 (1.126) 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs HKD 4.410 157 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs USD 4.854.957 (198.558) 24. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs USD 174.535 15.639 25. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Goldman Sachs USD 174.535 15.639 25. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan EUR 5.797 (340) 9. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan USD 1.861.593 (70.584) 22. Aug. 2022 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan USD 1.693.334 (92.233) 9. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley CHF 205.683 (17.277) 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley EUR 26.842 (718) 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley GBP 185.412 (4.670) 15. Mai 2023	17.896 (19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsEUR495.142(19.362)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsGBP42.491(1.126)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsHKD4.41015724. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(19.362) (1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsEUR495.142(19.362)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsGBP42.491(1.126)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsHKD4.41015724. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(1.126) 157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsHKD4.41015724. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	157 (198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD4.854.957(198.558)24. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteGoldman SachsUSD174.53515.63925. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(198.558) 15.639 (340) (70.584)
Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan EUR 5.797 (340) 9. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan USD 1.861.593 (70.584) 22. Aug. 2022 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan USD 1.693.334 (92.233) 9. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte J.P. Morgan USD 1.693.334 (92.233) 9. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley CHF 205.683 (17.277) 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley EUR 26.842 (718) 15. Mai 2023 Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley GBP 185.412 (4.670) 15. Mai 2023	15.639 (340) (70.584)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganEUR5.797(340)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(340) (70.584)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.861.593(70.584)22. Aug. 2022Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(70.584)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteJ.P. MorganUSD1.693.334(92.233)9. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyCHF205.683(17.277)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(92.233)
Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyEUR26.842(718)15. Mai 2023Kauf LongGesundheitswesen - ProdukteMorgan StanleyGBP185.412(4.670)15. Mai 2023	(17.277)
Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley GBP 185.412 (4.670) 15. Mai 2023	(718)
	(4.670)
	5.523
Kauf Long Gesundheitswesen - Produkte Morgan Stanley USD 550.382 (40.881) 15. Mai 2023	(40.881)
Kauf Long Gesundheitswesen - Dienstleistungen Goldman Sachs USD 4.912.826 (161.068) 24. Mai 2023	(161.068)
Kauf Long Gesundheitswesen - Dienstleistungen J.P. Morgan USD 627.648 (45.445) 22. Jun. 2022	(45.445)
Kauf Long Gesundheitswesen - Dienstleistungen J.P. Morgan USD 181.294 (10.128) 22. Aug. 2022	(10.128)
Kauf Long Gesundheitswesen - Dienstleistungen J.P. Morgan USD 1.575.540 (118.514) 9. Mai 2023	(118.514)
Kauf Long Gesundheitswesen - Dienstleistungen Morgan Stanley USD 1.343.268 (103.601) 15. Mai 2023	(103.601)
Kauf Long Holdinggesellschaften - Diverse Goldman Sachs USD 86.220 176 24. Mai 2023	176
Kauf Long Wohngebäude-Bauträger Goldman Sachs USD 256.680 (6.617) 24. Mai 2023	(6.617)
Kauf Long Wohngebäude-Bauträger Morgan Stanley USD 157.422 (7.627) 15. Mai 2023	(7.627)
Kauf Long Heimeinrichtungsgegenstände Morgan Stanley JPY 236.717 (8.410) 15. Mai 2023	(8.410)
Kauf Long Versicherungen Goldman Sachs CAD 293.740 (4.136) 25. Mai 2023	(4.136)
Kauf Long Versicherungen Goldman Sachs JPY 696.744 4.011 24. Mai 2023	4.011
Kauf Long Versicherungen Goldman Sachs USD 19.216 247 24. Mai 2023	247
Kauf Long Versicherungen J.P. Morgan GBP 294.026 (8.688) 9. Mai 2023	(8.688)
Kauf Long Versicherungen J.P. Morgan JPY 65.207 5.472 9. Mai 2023	5.472
Kauf Long Versicherungen J.P. Morgan USD 36.582 (769) 9. Mai 2023	(769)
Kauf Long Versicherungen Morgan Stanley HKD 157.237 (87) 15. Mai 2023	(87)
Kauf Long Versicherungen Morgan Stanley JPY 114.122 3.906 15. Mai 2023	3.906
Kauf Long Versicherungen Morgan Stanley USD 86.430 (2.549) 15. Mai 2023	(2.549)
Kauf Long Internet Goldman Sachs USD 192.672 17.552 24. Mai 2023	17.552
Kauf Long Internet J.P. Morgan USD 310.606 (22.257) 20. Okt. 2022	(22.257)
Kauf Long Internet J.P. Morgan USD 227.247 (3.380) 9. Mai 2023	(3.380)
Kauf Long Internet Morgan Stanley USD 1.324.553 (79.758) 15. Mai 2023	(79.758)
Kauf Long Investmentgesellschaften Morgan Stanley ZAR 499.536 104.142 15. Mai 2023	104.142
Kauf Long Maschinen - Diversifiziert Goldman Sachs USD 1.079.067 34.161 24. Mai 2023	34.161
Kauf Long Maschinen - Diversifiziert Goldman Sachs USD 4.697 28 25. Mai 2023	28
Kauf Long Medien J.P. Morgan USD 436.294 (18.643) 9. Mai 2023	(18.643)
Kauf Long Medien Morgan Stanley USD 84.647 925 27. Dez. 2021	925
Kauf Long Metallprodukte/Eisenwaren Morgan Stanley EUR 67.279 1.161 15. Mai 2023	1.161
Kauf Long Bergbau Goldman Sachs GBP 180.027 13.303 24. Mai 2023	13.303

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währun	g Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
•	IA Wellington Pagosa (Forts.)			g			(11010101100)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	USD	83.341	(537)	24. Mai 2023	(537
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	111.444	(16.135)	9. Mai 2023	(16.135
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	NOK	43.112	813	9. Mai 2023	813
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley		218.954	7.207	15. Mai 2023	7.207
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley		684.938	(68.200)	15. Mai 2023	(68.200
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	321.791	(27.710)	25. Mai 2023	(27.710
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	SEK	467.063	(27.128)	9. Mai 2023	(27.128
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	510.694	188.042	16. Dez. 2022	188.042
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	424.648	43.099	24. Mai 2023	43.099
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	106.341	13.767	9. Mai 2023	13.767
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	EUR	310.460	4.059	9. Mai 2023	4.059
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	GBP	1.017.590	111.135	9. Mai 2023	111.135
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	JPY	6.377	239	9. Mai 2023	239
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	1.966.442	251.157	9. Mai 2023	251.157
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley		4.879	557	15. Mai 2023	557
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley		301.534	34.881	15. Mai 2023	34.881
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley		1.419.404	129.570	15. Mai 2023	129.570
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	1.229.505	(1.259)	24. Mai 2023	(1.259
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	477.567	9.487	24. Mai 2023	9.487
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	1.437.023	64.564	24. Mai 2023	64.564
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	2.887.369	(44.004)	24. Mai 2023	(44.004
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	1.843.330	(1.116)	24. Mai 2023	(1.116
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	12.473	(1.000)	9. Mai 2023	(1.000
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	14.791	(224)	22. Aug. 2022	(224
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	87.434	(9.493)	9. Mai 2023	(9.493
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	219.168	(12.178)	20. Jul. 2022	(12.178
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	10.442	(600)	9. Mai 2023	(600
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HUF	317.458	(13.242)	9. Mai 2023	(13.242
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	2.729.689	(230.147)	22. Aug. 2022	(230.147
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	356.210	(33.202)	22. Nov. 2022	(33.202
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.380.279	(46.274)	9. Mai 2023	(46.274
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	53.738	3.603	15. Mai 2023	3.603
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	324.902	12.606	15. Mai 2023	12.606
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	144.921	6.849	15. Mai 2023	6.849
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	439.485	(3.750)	15. Mai 2023	(3.750
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.626.296	(44.666)	15. Mai 2023	(44.666
Kauf Long	Pipelines	Goldman Sachs	USD	183.138	17.831	24. Mai 2023	17.831
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1.958.931	19.863	9. Mai 2023	19.863
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	995.725	(18.220)	15. Mai 2023	(18.220
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	GBP	1.015.821	(13.073)	24. Mai 2023	(13.073
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	167.404	(5.864)	24. Mai 2023	(5.864
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	GBP	68.042	(3.893)	15. Mai 2023	(3.893
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	247.348	(17.294)	15. Mai 2023	(17.294
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	USD	2.893	(297)	15. Mai 2023	(297
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	293.748	(20.174)	9. Mai 2023	(20.174
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.063.855	(54.740)	24. Mai 2023	(54.740
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	699.444	(26.507)	15. Mai 2023	(26.507
Kauf Long	Spar- und Darlehensgeschäft	Morgan Stanley	USD	130.847	3.623	15. Mai 2023	3.623

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs (Wertverlust
•	Wellington Pagosa (Forts.)		, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,				,
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	70.031	(859)	24. Mai 2023	(859
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	14.233	(136)	24. Mai 2023	(130
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	326.329	(17.251)	9. Mai 2023	(17.25
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	369.605	7.520	9. Mai 2023	7.520
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley		299.820	(8.478)	27. Dez. 2021	(8.47)
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley		206.580	(8.044)	15. Mai 2023	(8.04
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	593.188	8.881	24. Mai 2023	8.88
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	3.702	504	25. Mai 2023	50-
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	254.078	(22.082)	22. Aug. 2022	(22.08)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	398.622	(24.083)	9. Mai 2023	(24.08)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	887.099	23.791	15. Mai 2023	23.79
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	515.655	(24.183)	9. Mai 2023	(24.18
Kauf Long	Transport	Goldman Sachs	GBP	10.913	880	24. Mai 2023	88
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	DKK	387.964	(23.504)	15. Mai 2023	(23.50
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley		418.603	(12.505)	15. Mai 2023	(12.50
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley		22.214.733	(166.301)	27. Mrz. 2023	(166.30
/erkauf Short	Fluggesellschaften	Morgan Stanley		44.245	(3.228)	15. Mai 2023	(3.22
/erkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley		141.122	3.389	3. Dez. 2021	3.38
/erkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley		194.379	339	15. Mai 2023	33
/erkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley		161.434	(11.638)	15. Mai 2023	(11.63
	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	191.033	(6.315)	24. Mai 2023	(6.31
	Automobilhersteller	Goldman Sachs	IPY	67.547	(695)	24. Aug. 2022	(69
	Automobilhersteller	Goldman Sachs	•	67.290	(2.323)	24. Mai 2023	(2.32
	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	170.532	(2.379)	22. Sept. 2022	(2.37
	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	307.117	(17.713)	24. Mai 2023	(17.71
/erkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	160.344	4.625	9. Mai 2023	4.62
/erkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	HKD	52.907	6.012	20. Sept. 2023	6.01
/erkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	390.784	(8.894)	9. Mai 2023	(8.89
/erkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	437.190	7.123	15. Mai 2023	7.12
/erkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	EUR	73.579	(1.213)	22. Sept. 2022	(1.21
/erkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	301.883	(4.857)	22. Sept. 2022	(4.85
/erkauf Short	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	29.927	4.435	9. Mai 2023	4.43
erkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	61.338	2.662	15. Mai 2023	2.66
erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	AUD	272.213	(7.537)	24. Mai 2023	(7.53
/erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	135.066	3.014	24. Mai 2023	3.01
/erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	DKK	472.811	(16.701)	24. Mai 2023	(16.70
/erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	2.881.864	(152.291)	24. Mai 2023	(152.29
/erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	HKD	655.553	(9.225)	24. Mai 2023	(9.22
/erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	550.725	3.213	24. Mai 2023	3.21
/erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	257.828	(4.018)	24. Mai 2023	(4.01
/erkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	9.091.768	(360.071)	24. Mai 2023	(360.07
/erkauf Short		J.P. Morgan	CAD	328.205	(3.256)	21. Dez. 2022	(3.25
/erkauf Short		J.P. Morgan	CZK	11.097	86	9. Mai 2023	8
/erkauf Short		J.P. Morgan	DKK	20.365	291	9. Mai 2023	29
/erkauf Short		J.P. Morgan	EUR	663.438	(24.805)	9. Mai 2023	(24.80
/erkauf Short		J.P. Morgan	HKD	30.961	1.434	9. Mai 2023	1.43
/erkauf Short		J.P. Morgan	JPY	143.876	1.289	9. Mai 2023	1.28
/erkauf Short		J.P. Morgan	PLN	16.576	790	9. Mai 2023	79

 $[\]hbox{* Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien gehalten}.$



chutz- osition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierte Wertzuwachs (Wertverlust
	A Wellington Pagosa (Forts.)	Kontranent	waniang	Nemberrag	Walkewere	tuiii	(Wertverlast
erkauf Short		J.P. Morgan	SEK	307.213	(10.365)	9. Mai 2023	(10.36
erkauf Short			USD	1.762.076	, ,	9. Mai 2023	•
		J.P. Morgan			(47.888)		(47.88
erkauf Short		Morgan Stanley		59.245	(479)	15. Mai 2023	(47
erkauf Short		Morgan Stanley		653.891	16.780	15. Mai 2023	16.78
erkauf Short		Morgan Stanley		189.415	(299)	15. Mai 2023	(29
erkauf Short		Morgan Stanley		169.952	942	15. Mai 2023	94
erkauf Short		Morgan Stanley		1.426.061	(75.901)	15. Mai 2023	(75.90
erkauf Short		Morgan Stanley		123.778	(6.668)	15. Mai 2023	(6.66
erkauf Short		Morgan Stanley		450.637	14.011	15. Mai 2023	14.01
erkauf Short		Morgan Stanley	-	264.321	6.899	15. Mai 2023	6.89
erkauf Short		Morgan Stanley		607.709	5.511	15. Mai 2023	5.51
erkauf Short		Morgan Stanley		750.269	(24.505)	15. Mai 2023	(24.50
erkauf Short		Morgan Stanley		2.770.921	32.910	15. Mai 2023	32.91
erkauf Short		J.P. Morgan	HKD	2.820	335	9. Mai 2023	33
erkauf Short		Morgan Stanley	HKD	354	-	15. Mai 2023	
erkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	AUD	506.104	23.083	24. Mai 2023	23.08
erkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	37.272	(65)	24. Mai 2023	(6
erkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	353.228	(851)	24. Mai 2023	(85
erkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.290.285	(24.160)	24. Mai 2023	(24.16
erkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	AUD	132.347	5.253	22. Jun. 2022	5.25
erkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	74.279	258	9. Mai 2023	25
erkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	20.537	2.949	9. Mai 2023	2.94
erkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	2.916.667	288.612	9. Mai 2023	288.61
erkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	CHF	54.191	(1.119)	15. Mai 2023	(1.11
erkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	71.799	4.741	15. Mai 2023	4.74
erkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1.647.162	(110.180)	15. Mai 2023	(110.18
erkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	148.767	844	22. Sept. 2022	84
erkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	159.334	10.417	24. Mai 2023	10.41
erkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	EUR	223.873	(2.207)	24. Mai 2023	(2.20
erkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	97.421	6.417	24. Mai 2023	6.41
erkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	147.990	3.282	22. Sept. 2022	3.28
erkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	JPY	5.805	914	22. Jun. 2022	9
erkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	SEK	12.649	1.105	5. Mai 2023	1.10
erkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	CHF	32.541	2.123	15. Mai 2023	2.12
erkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley		21.936	1.490	15. Mai 2023	1.49
erkauf Short		Goldman Sachs	USD	91.175	1.699	24. Mai 2023	1.69
erkauf Short	Chemie	J.P. Morgan	USD	93.887	1.474	9. Mai 2023	1.47
erkauf Short		Morgan Stanley		70.757	(1.728)	15. Mai 2023	(1.72
erkauf Short		Goldman Sachs		41.475	(2.203)	24. Mai 2023	(2.20
	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs		472.025	17.893	24. Mai 2023	17.89
	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	173.579	10.082	22. Sept. 2022	10.08
	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	329.016	11.767	22. Sept. 2022	11.76
	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.082.923	12.947	24. Mai 2023	12.94
	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	134.577	14.109	9. Mai 2023	14.10
	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	16.818	476	5. Mai 2023	47
	Severbilene Dienstielstungen	J.i . Ivioi gaii					
	Gewerhliche Dienstleistungen	I P Morgan	LISD	250 117	9/1 7//	9 Mai 2022	017
erkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan J.P. Morgan	USD USD	859.117 15.901	94.744 810	9. Mai 2023 22. Mai 2023	94.74 8 ⁷

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA	Wellington Pagosa (Forts.)						
	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	265.488	(261)	15. Mai 2023	(261)
Verkauf Short	3	Morgan Stanley		142.268	1.404	15. Mai 2023	1.404
	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	GBP	147.664	(622)	22. Sept. 2022	(622)
	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	IPY	152.399	629	24. Aug. 2022	629
	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	JPY	4.314	(128)	24. Mai 2023	(128)
	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley		13.663	(121)	15. Mai 2023	(121)
	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	GBP	81.983	1.447	24. Mai 2023	1.447
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	USD	386.105	2.496	22. Sept. 2022	2.496
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	USD	202.090	5.560	24. Mai 2023	5.560
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	1.027.625	(42.005)	24. Mai 2023	(42.005)
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen		EUR	1.558.029	(49.558)	24. Mai 2023	(49.558)
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen		GBP	1.838.907	(3.581)	24. Mai 2023	(3.581)
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen		USD	3.825.645	(35.382)	24. Mai 2023	(35.382)
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen		CHF	44.049	618	9. Mai 2023	618
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	EUR	242.122	(798)	9. Mai 2023	(798)
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	GBP	978.191	46.147	9. Mai 2023	46.147
	•	-	USD	1.238.759	56.547	9. Mai 2023	56.547
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	, ,	EUR	124.767	(266)	15. Mai 2023	(266)
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen		GBP	555.502	30.591	15. Mai 2023	30.591
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	,		645.650	56.597	15. Mai 2023	56.597
	Diversifizierte Finanzdienstleistungen			58.658	448	15. Mai 2023	448
Verkauf Short	•	Goldman Sachs	CAD	505.698	16.681	22. Sept. 2022	16.681
Verkauf Short		Goldman Sachs	DKK	111.744	4.228	24. Mai 2023	4.228
Verkauf Short		Goldman Sachs	EUR	528.753	(2.086)	24. Mai 2023	(2.086)
Verkauf Short		Goldman Sachs	HKD	3.152	(54)	24. Mai 2023	(54)
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	1.197.472	33.334	22. Sept. 2022	33.334
Verkauf Short		J.P. Morgan	HKD	47.334	2.961	5. Mai 2023	2.961
Verkauf Short		J.P. Morgan	USD	479.015	29.557	5. Mai 2023	29.557
Verkauf Short		J.P. Morgan	USD	223.569	10.389	9. Mai 2023	10.389
Verkauf Short		Morgan Stanley	HKD	54.759	(573)	15. Mai 2023	(573)
Verkauf Short		Morgan Stanley		455.580	39.437	15. Mai 2023	39.437
	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	EUR	231.275	3.303	22. Sept. 2022	3.303
	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	EUR	108.968	133	24. Mai 2023	133
	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	20.696	266	24. Mai 2023	266
	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	USD	21.044	1.103	9. Mai 2023	1.103
	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley		42.858	3.547	15. Mai 2023	3.547
	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley		21.082	472	15. Mai 2023	472
Verkauf Short		Goldman Sachs		1.074.647	82.634	24. Mai 2023	82.634
Verkauf Short			SEK	104.211	2.791	22. Sept. 2022	2.791
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	316.686	(777)	22. Sept. 2022	(777)
Verkauf Short		J.P. Morgan	JPY	63.592	4.242	9. Mai 2023	4.242
Verkauf Short		J.P. Morgan	USD	12.903	339	5. Mai 2023	339
Verkauf Short		J.P. Morgan	USD	655.196	101.738	22. Aug. 2023	101.738
Verkauf Short		Morgan Stanley	JPY	88.480	8.122	15. Mai 2023	8.122
	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	118.281	(5.774)	24. Mai 2023	(5.774)
	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	108.378	14.027	9. Mai 2023	14.027
	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	114.901	(12.540)	9. Mai 2023	(12.540)
	Encraic-Aiternative Efferuleucilett	j.i . ivioi yaii	JJD	114.501	(12.J 4 U)	J. IVIAI ZUZJ	(12.540)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA	\ Wellington Pagosa (Forts.)						
	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	2.805	55	15. Mai 2023	55
Verkauf Short	3 1	Morgan Stanley	USD	70.306	(1.552)	15. Mai 2023	(1.552)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Goldman Sachs	CHF	5.631	(158)	24. Mai 2023	(158)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Goldman Sachs	EUR	6.244	(447)	24. Mai 2023	(447)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Goldman Sachs	NZD	3.814	(135)	24. Mai 2023	(135)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Goldman Sachs	USD	140.976	126	22. Sept. 2022	126
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	J.P. Morgan	EUR	4.394	(24)	22. Aug. 2022	(24)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Morgan Stanley	EUR	280.116	(3.764)	15. Mai 2023	(3.764)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Morgan Stanley	MXN	3.759	(264)	15. Mai 2023	(264)
Verkauf Short	_	Morgan Stanley	USD	90.731	(2.956)	15. Mai 2023	(2.956)
Verkauf Short	Umweltschutz	Morgan Stanley	NOK	27.945	(265)	15. Mai 2023	(265)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	777.240	40.180	22. Mai 2023	40.180
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	791.739	(861)	24. Mai 2023	(861)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	2.228.880	47.868	24. Mai 2023	47.868
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	35.474	(1.273)	25. Mai 2023	(1.273)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	HKD	20.306	799	10. Mai 2022	799
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	238.440	2.913	5. Mai 2023	4.574
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	5.495.877	(211.055)	9. Mai 2023	(203.601)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	790.173	24.801	15. Mai 2023	24.801
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	21.530.199	11.415	15. Mai 2023	14.899
Verkauf Short	Index für fest/variabel verzinsliche Tit		USD	2.545.000	40.910	22. Nov. 2021	40.910
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	364.294	15.251	24. Mai 2023	15.251
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	214.621	15.577	9. Mai 2023	15.577
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	145.494	7.287	15. Mai 2023	7.287
Verkauf Short	Gas	Goldman Sachs	EUR	251.616	(3.125)	22. Sept. 2022	(3.125)
Verkauf Short	Gas	Goldman Sachs	EUR	269.363	(5.012)	24. Mai 2023	(5.012)
Verkauf Short	Gas	Goldman Sachs	USD	693.315	9.285	22. Sept. 2022	9.285
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Goldman Sachs	CHF	116.563	7.878	22. Sept. 2022	7.878
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Goldman Sachs	USD	170.743	8.055	24. Mai 2023	8.055
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	176.642	19.403	24. Mai 2023	19.403
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	472.532	20.974	24. Mai 2023	20.974
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	2.374.585	119.115	24. Mai 2023	119.115
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	DKK	307.299	20.842	9. Mai 2023	20.842
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	SEK	302.112	31.987	9. Mai 2023	31.987
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	650.311	19.394	9. Mai 2023	19.394
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	EUR	110.401	2.314	15. Mai 2023	2.314
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	275.807	2.169	15. Mai 2023	2.169
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	SEK	243.949	13.756	15. Mai 2023	13.756
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	977.495	16.269	15. Mai 2023	16.269
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	JPY	162.453	9.692	24. Mai 2023	9.692
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.201.482	29.752	24. Mai 2023	29.752
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	268.833	13.615	22. Jun. 2022	13.615
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	102.645	4.375	9. Mai 2023	4.375
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	86.729	2.855	9. Mai 2023	2.855
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	233.200	26.373	22. Aug. 2022	26.373
	Gesundheitswesen - Dienstleistungen		USD	216.709	(7.687)	23. Feb. 2023	(7.687)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	765.137	22.395	9. Mai 2023	22.395
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	759.952	72.524	15. Mai 2023	72.524

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA	A Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	172.876	10.959	15. Mai 2023	10.959
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	449.636	25.525	15. Mai 2023	25.525
Verkauf Short	Holdinggesellschaften - Diverse	Goldman Sachs	USD	129.810	(386)	24. Mai 2023	(386)
Verkauf Short	Holdinggesellschaften - Diverse	J.P. Morgan	USD	310.420	25.116	9. Mai 2023	25.116
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	54.880	(8.219)	24. Mai 2023	(8.219)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	144.245	3.581	22. Sept. 2022	3.581
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	USD	28.792	660	15. Mai 2023	660
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	35.991	486	24. Mai 2023	486
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	J.P. Morgan	USD	105.911	1.791	27. Mai 2022	1.791
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	1.087	14	15. Mai 2023	14
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	131.205	(6.983)	22. Sept. 2022	(6.983)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	887.461	(31.166)	24. Mai 2023	(31.166)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	HKD	413.722	(11.312)	24. Mai 2023	(11.312)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	JPY	263.470	5.121	24. Mai 2023	5.121
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	324.430	1.777	22. Sept. 2022	1.777
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	1.584.022	(28.343)	24. Mai 2023	(28.343)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	175.394	(11.952)	9. Mai 2023	(11.952)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	834.255	52.859	9. Mai 2023	52.859
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	104.693	(2.471)	5. Mai 2023	(2.471)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	510.542	16.910	9. Mai 2023	16.910
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	ZAR	172.221	(20.625)	9. Mai 2023	(20.625)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	242.464	(17.558)	15. Mai 2023	(17.558)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	GBP	647.914	2.262	15. Mai 2023	2.262
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	HKD	4.444	(85)	15. Mai 2023	(85)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	2.133.674	12.602	15. Mai 2023	12.602
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	ZAR	58.846	(3.418)	15. Mai 2023	(3.418)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	HKD	4.201	90	24. Mai 2023	90
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	JPY	56.290	303	24. Mai 2023	303
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	218.542	(12.810)	24. Mai 2023	(12.810)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	GBP	72.588	2.626	15. Mai 2023	2.626
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	HKD	4.235	(33)	15. Mai 2023	(33)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	366.764	11.186	15. Mai 2023	11.186
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	SEK	293.683	16.337	9. Mai 2023	16.337
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	SEK	576.032	12.379	15. Mai 2023	12.379
Verkauf Short	Eisen / Stahl	Goldman Sachs	USD	140.919	(1.359)	22. Sept. 2022	(1.359)
Verkauf Short	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	USD	102.712	6.220	5. Mai 2023	6.220
Verkauf Short	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	83.114	17.311	15. Mai 2023	17.311
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	201.599	1.706	24. Mai 2023	1.706
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	388.043	37.927	24. Okt. 2022	37.927
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	665.543	105.078	15. Mai 2023	105.078
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	306.372	(5.981)	15. Mai 2023	(5.981)
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	USD	86.632	(522)	24. Mai 2023	(522)
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	JPY	166.565	6.480	24. Mai 2023	6.480
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	422.244	24.297	24. Mai 2023	24.297
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	J.P. Morgan	JPY	113.097	9.143	9. Mai 2023	9.143
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Morgan Stanley	JPY	42.781	4.837	15. Mai 2023	4.837
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	GBP	102.401	(3.229)	24. Mai 2023	(3.229)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	133.356	5.973	22. Sept. 2022	5.973

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währund	g Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA	A Wellington Pagosa (Forts.)		•				
Verkauf Short		Goldman Sachs	USD	232.708	4.982	24. Mai 2023	4.982
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	USD	132.240	(701)	22. Sept. 2022	(701)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	USD	79.166	(8.377)	24. Mai 2023	(8.377)
Verkauf Short	'	J.P. Morgan	USD	103.687	7.333	5. Mai 2023	7.333
Verkauf Short	3	Goldman Sachs	EUR	74.292	7.511	22. Sept. 2022	7.511
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	GBP	100.877	(4.404)	22. Sept. 2022	(4.404)
	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	265.740	7.522	22. Sept. 2022	7.522
Verkauf Short		Goldman Sachs	AUD	400.727	(66.218)	24. Mai 2023	(66.218)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	374.682	(49.967)	24. Mai 2023	(49.967)
Verkauf Short		Goldman Sachs	JPY	168.195	(18.502)	24. Mai 2023	(18.502)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	119.621	(11.430)	22. Sept. 2022	(11.430)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	906.423	(83.928)	24. Mai 2023	(83.928)
Verkauf Short		J.P. Morgan	CAD	1.019.557	(271.753)	9. Mai 2023	(271.753)
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	EUR	178.282	(26.289)	9. Mai 2023	(26.289)
Verkauf Short		J.P. Morgan	GBP	126.618	849	9. Mai 2023	849
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	4.769.631	(681.224)	9. Mai 2023	(681.010)
Verkauf Short		Morgan Stanley		187.187	(27.470)	15. Mai 2023	(27.470)
Verkauf Short		Morgan Stanley		38.720	(3.714)	15. Mai 2023	(3.714)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley		20.121	(123)	15. Mai 2023	(123)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley		509.496	(22.308)	15. Mai 2023	(22.308)
	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	64.452	(8.310)	24. Mai 2023	(8.310)
	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	534.784	(34.431)	9. Mai 2023	(34.431)
	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	164.865	251	15. Mai 2023	251
	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	362.091	7.330	24. Mai 2023	7.330
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	693.333	(5.051)	24. Mai 2023	(5.051)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	IPY	826.588	408	24. Mai 2023	408
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	943.653	(6.649)	24. Mai 2023	(6.649)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	32.617	(1.584)	25. Mai 2023	(1.584)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	201.329	18.913	9. Mai 2023	18.913
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	338.850	4.579	9. Mai 2023	4.579
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HKD	458.738	30.236	9. Mai 2023	30.236
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	360.808	(5.953)	9. Mai 2023	(5.953)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.094.718	27.787	9. Mai 2023	27.787
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	CHF	145.400	(2.205)	15. Mai 2023	(2.205)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	284.916	6.612	15. Mai 2023	6.612
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	234.095	(3.435)	15. Mai 2023	(3.435)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley		214.056	9.678	15. Mai 2023	9.678
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley		1.005.963	43.514	15. Mai 2023	43.514
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	542.476	(12.111)	15. Mai 2023	(12.111)
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	529.976	(35.217)	24. Mai 2023	(35.217)
Verkauf Short	•	J.P. Morgan	USD	827.076	(9.538)	9. Mai 2023	(9.538)
Verkauf Short	•	Morgan Stanley		250.907	1.807	15. Mai 2023	1.807
	Private Equity	J.P. Morgan	USD	494.701	17.828	9. Mai 2023	17.828
Verkauf Short	• •	Goldman Sachs	HKD	16.049	(4.478)	24. Mai 2023	(4.478)
Verkauf Short		J.P. Morgan	HKD	10.903	(50)	9. Mai 2023	(50)
Verkauf Short		J.P. Morgan	USD	3.362	152	9. Mai 2023	152
Verkauf Short		Morgan Stanley		3.648	(6)	3. Mrz. 2022	(6)
	Immobilien	Morgan Stanley		234.789	5.990	15. Mai 2023	5.990

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währun	g Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAI	A Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	HKD	11.507	(848)	15. Mai 2023	(848)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	26.855	297	24. Mai 2023	297
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	484.391	15.243	22. Sept. 2022	15.243
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	205.757	9.689	5. Mai 2023	9.689
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	523.004	32.390	15. Mai 2023	32.390
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	JPY	3.835	62	24. Mai 2023	62
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	195.212	2.292	22. Sept. 2022	2.292
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	526.714	38.917	24. Mai 2023	38.917
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	218.766	(1.667)	5. Mai 2023	(1.667)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1.267.181	84.335	9. Mai 2023	84.335
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	CHF	198.446	3.340	15. Mai 2023	3.340
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	JPY	594	11	15. Mai 2023	11
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	SEK	452.227	2.372	15. Mai 2023	2.372
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	589.830	(62.145)	24. Mai 2023	(62.145)
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Morgan Stanley	USD	65.737	(5.913)	15. Mai 2023	(5.913)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	107.682	4.106	22. Sept. 2022	4.106
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	33.768	1.718	5. Mai 2023	1.718
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	32.255	2.304	15. Mai 2023	2.304
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	991.334	39.753	24. Mai 2023	39.753
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	85.366	545	24. Mai 2023	545
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	298.512	9.567	22. Sept. 2022	9.567
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	738.391	12.633	24. Mai 2023	12.633
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	CHF	53.093	5.142	9. Mai 2023	5.142
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	485.493	13.132	9. Mai 2023	13.132
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	14.917	535	15. Mai 2023	535
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	AUD	3.631	(67)	15. Mai 2023	(67)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	CHF	393.157	25.009	15. Mai 2023	25.009
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	EUR	253.438	9.923	15. Mai 2023	9.923
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	187.257	3.006	27. Dez. 2021	3.006
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	1.564.157	70.153	15. Mai 2023	70.153
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	66.770	3.631	27. Dez. 2021	3.631
Verkauf Short	Textilien	Goldman Sachs	USD	107.522	2.856	24. Mai 2023	2.856
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	194.650	(404)	22. Sept. 2022	(404)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	199.930	7.288	24. Mai 2023	7.288
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	DKK	36.742	3.430	9. Mai 2023	3.430
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	HKD	8.582	1.416	15. Mai 2023	1.416
						USD	(485.299)

Differenzkontrakte

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

Zum 30. September 2021 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend	Kontranent	Alizalli	Marktwert	(wertveriust)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Credit Suisse	(27)	(19.724)	(875)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Credit Suisse	3.304	538.906	11.603
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Credit Suisse	(174)	(110.386)	(1.729)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Credit Suisse	389	567.123	(27.709)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Credit Suisse	760	514.950	(36.296)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Credit Suisse	491	393.848	(24.240)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Credit Suisse	855	777.693	(5.571)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Credit Suisse	520	598.951	(26.563)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Inde		469	403.815	(18.705)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Credit Suisse	2.088	735.241	(12.145)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Credit Suisse	1.097	440.606	(14.644)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Credit Suisse	2.790	898.342	71.071
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Credit Suisse	(56)	(64.170)	838
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Hodsenold Goods Index	Credit Suisse	(504)	(254.482)	4.523
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Credit Suisse	(304)	390.662	(27.752)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Credit Suisse	1.312	349.574	(5.341)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Credit Suisse	1.995	603.702	(6.736)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Credit Suisse	317	131.945	(12.375)
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	1.480	2.115.935	(56.118)
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	2.596	1.855.055	(87.270)
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	2.390	946.549	26.103
CFD auf den S&P 500 Einergy Sector Index	Goldman Sachs	2.121	1.324.772	(26.504)
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	661	980.915	(59.241)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	(88)	(72.761)	(3.972)
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	289	758.288	(46.895)
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	(281)	(139.556)	(5.659)
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	3.080	999.712	(68.617)
CFD auf deft SQF 500 Othlities Sector Index	Goldman Sacris	3.080	USD 15.665.505	(460.819)
Schroder GAIA Contour Tech Equity			15.005.505	(400.015)
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(72.343)	(81.589)	(81.589)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	(1.165.611)	354.943	354.943
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(2.069.000)	1.304.827	1.304.827
CFD auf französische Aktien	Morgan Stanley	81.900	(371.886)	(371.886)
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	322.102	(2.581.899)	(2.581.899)
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(76.098)	341.680	341.680
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(565.228)	(1.150.513)	(1.150.513)
CFD auf japanische Aktien	Morgan Stanley	(28.224)	(158.352)	(158.352)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	667.800	(2.658.443)	(2.658.443)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(117.389)	1.165.673	1.165.673
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1.470.624)	7.644.793	7.644.785
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.210.544)	9.501.630	9.504.129
	ga stariley	(USD 13.310.864	13.313.355

Differenzkontrakte (Forts.)

billerelizkolitrakte (Forts.)				Nicht realisierter Wertzuwachs/
Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	(Wertverlust)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf argentinische Aktien	Goldman Sachs	529	(105.215)	(105.215)
CFD auf argentinische Aktien	J.P. Morgan	2.321	(258.230)	(258.230)
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	2.580.911	(325.049)	(325.049)
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	1.880.101	79.831	79.831
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	74.840	(31.212)	(31.212
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	54.040	56.622	56.622
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	89.006	150.950	150.950
CFD auf belgische Aktien	J.P. Morgan	27.464	44.819	44.819
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	6.814	(1.741)	(1.741)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	37.431.117	(2.351.621)	(1.316.996
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	3.152.543	(546.632)	(546.632
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	57.630	(88.093)	(88.093)
CFD auf kanadische Aktien	I.P. Morgan	131.531	109.966	109.966
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	17.562.310	(3.026.160)	(3.025.792
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	10.297.699	158.532	158.531
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	46.767	(82.196)	(82.196
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	182.256	176.311	176.311
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	1.203.099	(131.322)	(131.322
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	310.112	(1.083.250)	(1.083.250
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	254.216	(241.861)	(241.861
CFD auf finnische Aktien	J.P. Morgan	84.048	78.974	78.974
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	387.736	(764.437)	(764.434
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	40.021	(149.689)	(149.689
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	289.386	(659.932)	(659.932
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	258.108	(634.052)	(634.052
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	6.646.889	(1.230.988)	(1.230.988
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	5.043.400	718.754	718.754
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	140.261	(272.763)	(272.763
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	176.526	2.733	2.733
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	152.780	(291.209)	(291.209
CFD auf irische Aktien		69.912	20.084	20.084
CFD auf insche Aktien	J.P. Morgan Goldman Sachs	1.159	(9.120)	(9.120
CFD auf israelische Aktien	J.P. Morgan	2.361	1.912	
CFD auf italienische Aktien				1.912
	Goldman Sachs	209.900	(42.111)	(42.111
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	3.635.700	(922.112)	(922.437
CFD out Altion our lorses:	J.P. Morgan	7.891.357	(3.395.066)	(3.394.400
CFD auf lawsitische Altice	Goldman Sachs	4.727	(2.357)	(2.357
CFD auf kuwaitische Aktien	J.P. Morgan	(844.478)	34.310	34.310
CFD auf Alxier and Marcon	Goldman Sachs	(2.920)	50.278	50.278
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	145.000	(163.552)	(163.552
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	131.396	(9.768)	(9.768
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	747.957 222.656	(66.394)	(66.394 2.974
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	222.656	2.974	
CFD auf philippinische Aktien	J.P. Morgan	269.205	155.079 1.609	155.079
CFD auf philippinische Aktien CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs Goldman Sachs	(190.090) (106.302)	134.744	1.609 134.744
CFD auf poinische Aktien	J.P. Morgan	(22.850)	(25.407)	(25.407
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	75.372	4.278	4.278
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	3.618.567	182.850	182.850
CLD and Inspirent Akriell	GOIGITIATI SACTIS	3.010.307	102.000	102.850

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf russische Aktien	J.P. Morgan	12.065	(6.340)	(6.340)
CFD auf saudi-arabische Aktien	Goldman Sachs	4.873	(78.586)	(78.586)
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	117.024	825	825
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	2.982.239	(133.492)	(133.492)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	2.083.600	54.872	54.872
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	61.449	(275.641)	(275.641)
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	(217.579)	69.116	69.116
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	634.579	162.973	162.973
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	575.292	(924.211)	(924.211)
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	1.386.053	(839.507)	(839.516)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	17.802	22.998	22.913
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	245.209	(677.149)	(677.149)
CFD auf taiwanesische Aktien	Goldman Sachs	33.170	(359.098)	(359.098)
CFD auf taiwanesische Aktien	J.P. Morgan	(1.869.512)	(156.498)	(156.498)
CFD auf türkische Aktien	Goldman Sachs	(6.101.920)	152.413	152.413
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	J.P. Morgan	58.786	(4.832)	(4.832)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	27.828.392	(2.564.426)	(2.568.548)
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	1.155.443	(4.076.561)	(4.076.258)
CFD auf den FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(589)	274.272	274.272
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(65.832)	3.677.420	3.677.420
CFD auf den MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(416)	(11.937)	(11.937)
			USD (20.439.318)	(19.407.895)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
CFD auf britische Aktien	Bank of America	(257.934)	(1.351)	(1.351)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	2.390.843	14.327	14.327
CFD auf chinesische Aktien	Morgan Stanley	122.642	(17.170)	(17.170)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(31.189)	(44.725)	(44.725)
CFD auf den FTSE 250 Index	Bank of America	(281)	104.091	153.149
CFD auf den MSBEUK01 Index	Morgan Stanley	(14.424)	(31.877)	(31.877)
			GBP 23.295	72.353

Credit Default Index

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

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

Am 30. September 2021 waren die folgenden Teilfonds Credit Default Index-Kontrakte auf Finanzindizes eingegangen:

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder G	GAIA BlueTrend						
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 36 20/12/2026	J.P. Morgan	EUR	29.000.000	5,00	20. Dez. 2026	4.007.587
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	J.P. Morgan	EUR	105.000.000	1,00	20. Dez. 2026	3.206.538
Verkauf	CDX North America High Yield Series 37 20/12/2026	J.P. Morgan	USD	41.000.000	5,00	20. Dez. 2026	3.744.111
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 37 20/12/2026	J.P. Morgan	USD	132.000.000	1,00	20. Dez. 2026	3.168.124
						USD	14.126.360
	GAIA Two Sigma Diversified						
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 36 20/12/2026	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20. Dez. 2026	(7.550)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	Citi Bank	EUR	6.000.000	1,00	20. Dez. 2026	1.003
Verkauf	CDX North America High Yield Series 37 20/12/2026	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20. Dez. 2026	(89.289)
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 37 20/12/2026	Citi Bank	USD	50.000.000	1,00	20. Dez. 2026	5.652
						USD	(90.184)
Schroder 6	GAIA Wellington Pagosa						
Verkauf	CDX Emerging Markets Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	USD	3.440.000	1,00	20. Dez. 2026	14.261
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	5.335.000	5,00	20. Dez. 2026	(16.405)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	5.709.000	1,00	20. Jun. 2026	(13.136)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	9.370.000	1,00	20. Dez. 2026	(7.375)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	5.875.000	1,00	20. Dez. 2026	1.920
Verkauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	3.050.000	1,00	20. Dez. 2026	(6.845)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 32 20/06/2024	Morgan Stanley	USD	2.670.000	5,00	20. Jun. 2024	(7.666)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 37 20/12/2026	Morgan Stanley	USD	8.465.000	5,00	20. Dez. 2026	40.765
Verkauf	CDX North America Investment Grade	Morgan	335	3. 133.300	3,00	20. 502. 2020	10.702
	Series 37 20/12/2026	Stanley	USD	8.275.000	1,00	20. Dez. 2026	806
						USD	6.325

Credit Default Swaps

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

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

Zum 30. September 2021 war der folgende Teilfonds Credit-Default-Swap-Kontrakte eingegangen:

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder G	AIA Wellington Pagosa						
Verkauf	Australien	Bergbau	Morgan Stanley	EUR	425.000	20. Dez. 2026	5.460
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	3.225.000	20. Dez. 2026	7.657
Verkauf	Brasilien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	369.000	20. Dez. 2025	6.409
Verkauf	Brasilien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.956.000	20. Jun. 2026	(10.862)
Verkauf	Brasilien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.630.000	20. Dez. 2026	10.798
Verkauf	Chile	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.773.000	20. Dez. 2026	7.482
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.295.000	20. Jun. 2026	(5.820)
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	455.000	20. Dez. 2026	2.444
Verkauf	Kolumbien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	954.000	20. Jun. 2026	(9.676)
Verkauf	Kolumbien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.455.000	20. Dez. 2026	15.438
Verkauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	850.000	20. Dez. 2026	173
Verkauf	Frankreich	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	500.000	20. Dez. 2026	2.604
Kauf	Frankreich	Banken	Barclays Bank	EUR	5.800.000	20. Dez. 2026	5.828
Kauf	Frankreich	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	425.000	20. Dez. 2026	3.157
Verkauf	Frankreich	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	1.675.000	20. Dez. 2026	2.526
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurswesen	Morgan Stanley	EUR	2.600.000	20. Dez. 2026	6.347
Verkauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	950.000	20. Dez. 2026	(1.228)
Verkauf	Frankreich	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	EUR	1.225.000	20. Dez. 2026	(9.466)
Verkauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	2.400.000	20. Dez. 2026	5.429
Verkauf	Indonesien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.140.000	20. Dez. 2025	9.680
Verkauf	Indonesien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	183.000	20. Jun. 2026	94
Kauf	Italien	Banken	Barclays Bank	EUR	950.000	20. Dez. 2026	(3.003)
Kauf	Luxemburg	Chemie	J.P. Morgan	EUR	450.000	20. Dez. 2026	(11.394)
Verkauf	Luxemburg	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	EUR	675.000	20. Dez. 2026	9.047
Kauf	Luxemburg	Medien	Barclays Bank	EUR	525.000	20. Dez. 2024	27.418
Verkauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Goldman Sachs	USD	1.007.000	20. Jun. 2026	(3.347)
Verkauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Citi Bank	USD	307.000	20. Jun. 2026	(188)
Verkauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	EUR	1.875.000	20. Dez. 2026	(7.535)
Verkauf	Mexiko	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	444.000	20. Jun. 2026	(1.166)
Verkauf	Mexiko	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.680.000	20. Dez. 2026	3.722
Verkauf	Niederlande	Transport	Morgan Stanley	EUR	950.000	20. Dez. 2026	340
Verkauf	Philippinen	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.555.000	20. Dez. 2025	(9.150)
Verkauf	Russische Föderation	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	889.000	20. Jun. 2026	(4.897)
Verkauf	Russische Föderation	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	575.000	20. Dez. 2026	382
Verkauf	Saudi-Arabien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	435.000	20. Dez. 2025	4.838
Verkauf	Südafrika	Bergbau	Morgan Stanley	EUR	500.000	20. Dez. 2026	8.735
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	875.000	20. Dez. 2026	(541)
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.855.000	20. Dez. 2024	13.974

Credit Default Swaps (Forts.)

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder G	AIA Wellington Pagosa (F	Forts.)					
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.735.000	20. Dez. 2026	(1.527)
Kauf	Spanien	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	875.000	20. Dez. 2026	46.357
Verkauf	Türkei	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	3.060.000	20. Jun. 2026	(19.978)
Verkauf	Türkei	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.845.000	20. Dez. 2026	28.147
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	950.000	20. Dez. 2026	(1.782)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	237.500	20. Jun. 2024	6.641
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410.000	20. Dez. 2025	(33.525)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	750.000	20. Dez. 2026	21.819
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	3.350.000	20. Dez. 2026	10.829
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	3.000.000	20. Dez. 2026	(39.367)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	800.000	20. Dez. 2026	(779)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	BNP Paribas	EUR	175.000	20. Dez. 2022	(853)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Bank of America	EUR	150.000	20. Dez. 2022	(731)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	2.612.500	20. Dez. 2026	15.794
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmitteldienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	925.000	20. Dez. 2026	(745)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	1.700.000	20. Dez. 2026	14.159
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	925.000	20. Dez. 2026	(241)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	1.625.000	20. Dez. 2026	(497)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	825.000	20. Jun. 2026	(23.029)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.075.000	20. Dez. 2026	12.243
Kauf	Vereinigte Staaten	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500.000	20. Dez. 2024	(2.323)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910.000	20. Jun. 2025	(40.163)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Medien	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20. Dez. 2024	(54.030)
Kauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705.000	20. Jun. 2024	(74.107)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1.920.000	20. Jun. 2025	68.763
						USD	12.784

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 einem bestimmten Jahr auf zwei verschiedene Währungen lautende Zinszahlungen auszutauschen.

 ${\it Zum\,30. September\,2021\,war\,der\,folgende\,Teilfonds\,in\,Cross-Currency\,Swap-Kontrakten\,engagiert:}$

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeit	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA We	llington Pago	sa						
Bank of America	RUB	248.615.000	USD	3.391.746	15. Dez. 2023	6,48 %	USD LIBOR 3 Months	1.268
Bank of America	RUB	241.307.000	USD	3.292.046	16. Mrz. 2024	6,35 %	USD LIBOR 3 Months	956
Bank of America	RUB	5.145.000	USD	70.239	21. Jun. 2026	4,80 %	USD LIBOR 3 Months	3.680
Bank of America	USD	653.287	MXN	13.020.000	3. Dez. 2031	USD LIBOR 1 Month	MXN TIIE 28 Days	(1.306)
Barclays	RUB	524.543.000	USD	7.275.215	15. Dez. 2023	6,35 %	USD LIBOR 3 Months	139.115
Barclays	TRY	10.266.000	USD	1.222.143	20. Dez. 2026	16,50 %	USD LIBOR 3 Months	88.581
Citibank	CNH	3.806.000	USD	580.183	16. Mrz. 2024	2,71 %	USD LIBOR 3 Months	(9.100)
Citibank	CNH	3.805.000	USD	580.030	16. Mrz. 2024	2,74 %	USD LIBOR 3 Months	(9.413)

Cross-Currency Swap-Kontrakte (Forts.)

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeit	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA We	ellington Pago	sa (Forts.)						
Goldman Sachs	RUB	368.390.000	USD	5.027.499	15. Dez. 2026	5,86 %	USD LIBOR 3 Months	67.922
Goldman Sachs	RUB	140.109.000	USD	1.943.259	15. Dez. 2026	5,94 %	USD LIBOR 3 Months	51.423
Goldman Sachs	TRY	32.261.000	USD	3.627.889	16. Mrz. 2023	20,54 %	USD LIBOR 3 Months	(5.900)
J.P. Morgan	RUB	75.162.000	USD	1.071.218	21. Dez. 2025	4,09 %	USD LIBOR 3 Months	91.038
J.P. Morgan	RUB	74.938.000	USD	1.025.284	15. Dez. 2026	5,77 %	USD LIBOR 3 Months	20.608
J.P. Morgan	RUB	61.264.000	USD	848.649	20. Dez. 2026	5,68 %	USD LIBOR 3 Months	12.034
J.P. Morgan	RUB	347.879.000	USD	4.747.419	16. Mrz. 2027	5,85 %	USD LIBOR 3 Months	47.560
J.P. Morgan	TRY	6.405.000	USD	755.663	15. Dez. 2023	18,93 %	USD LIBOR 3 Months	46.194
J.P. Morgan	TRY	11.358.000	USD	1.364.160	16. Mrz. 2024	18,22 %	USD LIBOR 3 Months	113.605
J.P. Morgan	TRY	14.470.000	USD	1.655.322	16. Mrz. 2024	19,01 %	USD LIBOR 3 Months	43.515
J.P. Morgan	TRY	15.255.000	USD	1.721.395	16. Mrz. 2024	19,66 %	USD LIBOR 3 Months	6.164
J.P. Morgan	TRY	18.650.000	USD	2.112.357	16. Mrz. 2024	19,99 %	USD LIBOR 3 Months	5.406
J.P. Morgan	TRY	10.547.000	USD	1.348.721	21. Jun. 2026	11,88 %	USD LIBOR 3 Months	280.433
J.P. Morgan	USD	15.444.720	GBP	10.944.000	15. Dez. 2026	USD LIBOR 3 Months	GBP LIBOR 3 Months	(757.408)
J.P. Morgan	USD	653.943	MXN	13.020.000	3. Dez. 2031	USD LIBOR 1 Month	MXN TIIE 28 Days	(1.969)
Morgan Stanley	USD	3.742.297	AUD	4.882.000	15. Dez. 2026	USD LIBOR 3 Months	AUD BBR 6 Months	(199.723)
Morgan Stanley	USD	11.750.405	AUD	16.113.000	16. Mrz. 2027	USD LIBOR 3 Months	AUD BBR 6 Months	(75.802)
Morgan Stanley	USD	3.611.626	CAD	4.380.000	15. Dez. 2026	USD LIBOR 3 Months	CAD BA 3 Months	(155.194)
Morgan Stanley	USD	11.762.517	CAD	14.859.000	16. Mrz. 2027	USD LIBOR 3 Months	CAD BA 3 Months	(45.939)
Morgan Stanley	USD	3.832.667	NOK	32.199.000	15. Dez. 2026	USD LIBOR 3 Months	NZD BBR 3 Months	(150.907)
Morgan Stanley	USD	11.581.685	NOK	101.100.000	16. Mrz. 2027	USD LIBOR 3 Months	NZD BBR 3 Months	(21.290)
Morgan Stanley	USD	3.694.502	NZD	5.161.000	15. Dez. 2026		NZD BBR 3 Months	(131.557)
Morgan Stanley	USD	11.697.993	NZD	16.715.000	16. Mrz. 2027	USD LIBOR 3 Months	NZD BBR 3 Months	(165.920)
Morgan Stanley	USD	3.202.741	SEK	26.736.000	15. Dez. 2026	USD LIBOR 3 Months	SEK STIBOR 3 Months	(150.326)
Morgan Stanley	USD	12.259.400	SEK	106.034.000	16. Mrz. 2027	USD LIBOR 3 Months	SEK STIBOR 3 Months	(132.669)
						J WIGHTIS	USD	(994.921)

Zins-Swaps

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

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

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

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

Zum 30. September 2021 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend			3		, ,
Zahlt Festzinssatz -0,31 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	2.000.000	CHF	15. Dez. 2026	(2.930)
Zahlt Festzinssatz 0,06 %	, j				, ,
Erhält variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	1.000.000	CHF	15. Dez. 2031	2.494
Zahlt Festzinssatz 6,04 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	200.000.000	MXN	13. Dez. 2023	107.771
Zahlt Festzinssatz 7,11 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	50.000.000	MXN	3. Dez. 2031	73.769
Zahlt Festzinssatz 0,33 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	100.000.000	JPY	15. Dez. 2041	(2.388)
Zahlt Festzinssatz 5,12 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	100.000.000	ZAR	15. Dez. 2023	4.203
Zahlt Festzinssatz -0,40 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	25.000.000	EUR	15. Dez. 2023	(2.761)
Zahlt Festzinssatz 0,17 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	SEK	15. Dez. 2023	(1.454)
Zahlt Festzinssatz 0,54 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	20.000.000	SEK	15. Dez. 2026	1.347
Zahlt Festzinssatz 0,90 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	10.000.000	SEK	15. Dez. 2031	2.813
Zahlt Festzinssatz 1,38 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.000.000	USD	15. Dez. 2028	(952)
Zahlt Festzinssatz 1,83 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	500.000	USD	15. Dez. 2046	963
Zahlt Festzinssatz 1,81 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.000.000	USD	15. Dez. 2041	669
Zahlt Festzinssatz 0,99 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	3.000.000	USD	15. Dez. 2025	(1.869)
Zahlt Festzinssatz 0,48 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	10.000.000	USD	15. Dez. 2023	(4.280)
Zahlt Festzinssatz 0,33 %	15.44	200 000 000	IDV	45.5 2044	(44 522)
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 12 Months	J.P. Morgan	200.000.000	JPY	15. Dez. 2041	(11.532)
Zahlt Festzinssatz 0,91 %	LD Mai	10.000.000	CEIV	4F.D. 2021	2.224
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	10.000.000	SEK	15. Dez. 2031	2.234
Zahlt Festzinssatz 6,80 %	ID Morgan	60.000.000	MVNI	0 De- 2020	47.000
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	60.606.060	MXN	9. Dez. 2026	47.958
Zahlt Festzinssatz 6,81 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	I.P. Morgan	30 202 040	MYNI	0 Doz 2026	20.057
Ernait variablen Zirissatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	39.393.940	MXN	9. Dez. 2026	29.957

·					
Parathus ihang	Manaturals and	Name	14/# h	Fälligkeitsda-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	tum	(Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	200.000.000	ZAR	15. Dez. 2026	(304.241)
Zahlt Festzinssatz 0,79 %		40.000.000		45.5	404040
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	10.000.000	NZD	15. Dez. 2023	104.010
Erhält Festzinssatz 0,18 %	LD Manage	F2 F20 CC0	LICD	45 D 2022	(200 222)
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	52.539.660	USD	15. Dez. 2023	(289.323)
Erhält Festzinssatz 0,46 % Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	ID Morgan	34.294.785	SEK	15. Dez. 2031	(176.775)
Zahlt Festzinssatz 1,11 %	J.P. Morgan	34.234.763	SEK	13. Dez. 2031	(170.773)
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	34.294.785	SEK	15. Dez. 2031	(69.728)
Zahlt Festzinssatz 0,60 %	J.i . Worgan	34.234.703	JLIK	13. DC2. 2031	(03.720)
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	7.539.660	USD	15. Dez. 2023	(21.423)
Zahlt Festzinssatz 0,72 %	,ga	7,000,000	002	.0. 5 02. 2020	(2.1.23)
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	48.979.667	SEK	15. Dez. 2026	(46.255)
Erhält Festzinssatz 4,72 %	, g.				(,
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	167.000.000	ZAR	15. Dez. 2023	(88.810)
Erhält Festzinssatz 0,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	48.979.667	SEK	15. Dez. 2026	(104.527)
Zahlt Festzinssatz 2,26 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.485.020	USD	15. Dez. 2046	(130.982)
Zahlt Festzinssatz 1,12 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	12.104.754	USD	15. Dez. 2025	(71.917)
Erhält Festzinssatz 1,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.485.020	USD	15. Dez. 2046	(103.876)
Erhält Festzinssatz 1,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.618.660	USD	15. Dez. 2041	(93.994)
Zahlt Festzinssatz 2,23 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.618.660	USD	15. Dez. 2041	(117.006)
Erhält Festzinssatz 0,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 12 Months	J.P. Morgan	200.000.000	JPY	15. Dez. 2041	(37.008)
Erhält Festzinssatz 0,19 %			15) (45.5 0044	(444.005)
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 12 Months	J.P. Morgan	600.000.000	JPY	15. Dez. 2041	(111.025)
Erhält Festzinssatz 0,94 % Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	ID Margan	2.000.201	LICD	15 Dec 2020	(100 200)
Erhält Festzinssatz 0,50 %	J.P. Morgan	3.696.261	USD	15. Dez. 2028	(109.390)
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	40.000.000	EUR	15. Dez. 2023	(91.133)
Erhält Festzinssatz -0,50 %	J.F. Morgan	40.000.000	EUK	13. Dez. 2023	(31.133)
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	50.000.000	EUR	15. Dez. 2023	(113.918)
Zahlt Festzinssatz 1,63 %	J.i . Worgan	30.000.000	LOIK	13. DC2. 2023	(113.510)
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	3.696.261	USD	15. Dez. 2028	(64.252)
Erhält Festzinssatz 4,72 %	, . <u>.</u>	·			(- · -)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	333.000.000	ZAR	15. Dez. 2023	(177.089)
Erhält Festzinssatz 1,73 %	- 5				,
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	534.091	NZD	15. Dez. 2031	(18.875)
Zahlt Festzinssatz 2,26 %	-				
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	6.534.091	NZD	15. Dez. 2031	15.082
	-				

ziiis-swaps (i oi ts.)					
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,64 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	10.000.000	NZD	15. Dez. 2026	101.936
Erhält Festzinssatz -0,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	118.588.669	SEK	15. Dez. 2023	(51.620)
Zahlt Festzinssatz 0,27 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	68.588.669	SEK	15. Dez. 2023	(16.994)
Erhält Festzinssatz 0,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	15.104.754	USD	15. Dez. 2025	(212.999
Zahlt Festzinssatz 0,99 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	3.000.000	USD	15. Dez. 2025	(2.937)
Zahlt Festzinssatz 1,86 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	500.000	USD	15. Dez. 2046	(2.534)
Zahlt Festzinssatz 1,41 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.000.000	USD	15. Dez. 2028	(4.817)
Erhält Festzinssatz -0,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	5.549.070	CHF	15. Dez. 2026	(94.946
Erhält Festzinssatz -0,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	5.549.070	CHF	15. Dez. 2026	(36.320
Erhält Festzinssatz 0,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	5.049.985	CHF	15. Dez. 2031	(62.089
Erhält Festzinssatz -0,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	5.049.985	CHF	15. Dez. 2031	(210.260
Erhält Festzinssatz 0,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	1.000.000	CHF	15. Dez. 2031	3.613
Erhält Festzinssatz 8,98 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	45.399.335	BRL	2. Jan. 2024	202.505
Erhält Festzinssatz 6,79 %	ID Manage	F 200 22F	DDI	2 1 2024	(62.270
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	5.399.335	BRL	2. Jan. 2024	(63.378
Erhält Festzinssatz 8,28 %	ID Margan	00 257 260	DDI	2 100 2022	214 200
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	88.357.360	BRL	2. Jan. 2023	214.206
Erhält Festzinssatz 6,33 %	ID Morgan	9 257 260	BRL	2 lan 2022	(47.017
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	8.357.360	DKL	2. Jan. 2023 USD	(47.917 (2.260.994
Schroder GAIA Wellington Pagosa				030	(2.200.334
Zahlt Festzinssatz 7,10 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	2.097.453	BRL	4. Jan. 2027	53.392
Zahlt Festzinssatz 7,71 %	o. ga o.ao,	2,0371.00	2.12	, 2027	33.332
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	11.711.490	BRL	4. Jan. 2027	227.651
Erhält Festzinssatz 2,84 %	o. ga o.ao,		2.12	, 2027	
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	6.141.000	AUD	17. Jun. 2031	101.754
Erhält Festzinssatz 1,94 %	. g		-	. ,	
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Deutsche Bank	850.000	ILS	17. Jun. 2031	(436
Zahlt Festzinssatz 8,01 %				• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	() = -
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	8.960.782	BRL	4. Jan. 2027	147.031
Zahlt Festzinssatz 8,07 %	J,			3 -	
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	11.522.847	BRL	4. Jan. 2027	181.536
	. 5	,=·			

21113-344aps (1 01 ts.)					
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,75 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	2.818.214	BRL	4. Jan. 2027	54.173
Zahlt Festzinssatz 7,74 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	464.072	BRL	4. Jan. 2027	9.082
Erhält Festzinssatz 7,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.215.040	MXN	16. Sep. 2026	(5.628)
Erhält Festzinssatz 3,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	176.933.000	HUF	16. Sept. 2031	(8.009)
Erhält Festzinssatz 3,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	304.018.000	HUF	16. Sept. 2031	(16.212)
Erhält Festzinssatz 6,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	3.727.995.000	COP	16. Sept. 2031	(27.240)
Erhält Festzinssatz 7,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	5.960.351.000	COP	16. Sept. 2031	(28.511)
Erhält Festzinssatz 5,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	61.138.000	MXN	20. Sept. 2023	(30.502)
Erhält Festzinssatz 1,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.200.000	PLN	21. Dez. 2023	(3.135)
Erhält Festzinssatz 5,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Goldman Sachs	194.032.000	INR	15. Dez. 2026	15.631
Zahlt Festzinssatz 0,78 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.051.000	GBP	15. Dez. 2031	37.870
Zahlt Festzinssatz 1,06 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.425.000	GBP	16. Dez. 2031	87.769
Erhält Festzinssatz 0,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.224.000	GBP	21. Dez. 2023	(12.089)
Zahlt Festzinssatz 0,50 %	Managa Charalan	4.672.000	CDD	45 D 2026	75 202
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.673.000	GBP	15. Dez. 2026	75.293
Zahlt Festzinssatz 0,72 %	Margan Ctanlay	2 410 000	CDD	20. Dez. 2026	24.740
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.419.000	GBP	20. Dez. 2026	24.748
Zahlt Festzinssatz 0,22 % Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.414.000	GBP	15. Dez. 2023	72.891
Erhält Festzinssatz 1,22 %	worgan stanley	11.414.000	GDP	15. Dez. 2023	72.091
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	29.750.000	NOK	15. Dez. 2023	(14.451)
Zahlt Festzinssatz 0,44 %	Worgan Starticy	23.730.000	NOR	13. DC2. 2023	(14.451)
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	113.833.000	SEK	15. Dez. 2026	103.848
Zahlt Festzinssatz 0,16 %	Worgan Stamey	113.033.000	JEN	13. 5 62. 2020	103.010
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	203.000	EUR	15. Dez. 2031	1.176
Zahlt Festzinssatz 4,78 %	g				
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	4.509.385.000	СОР	15. Dez. 2023	1.945
Erhält Festzinssatz 6,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	4.094.833.000	COP	16. Dez. 2031	(34.338)
Erhält Festzinssatz 5,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Bank of America	118.377.000	INR	15. Dez. 2026	9.398
Zahlt Festzinssatz 1,10 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.285.000	USD	15. Dez. 2031	77.396
	,				

ziiis swaps (i oi ts.)					
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 0,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	10.870.000	USD	15. Dez. 2026	(192.434
Zahlt Festzinssatz 0,23 %	, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,				
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	13.465.000	USD	15. Dez. 2023	34.159
Zahlt Festzinssatz 1,80 %	,				
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.550.000	PLN	15. Dez. 2031	39.954
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.686.000	NZD	15. Dez. 2026	19.835
Zahlt Festzinssatz 1,77 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	1.594.355.000	KRW	16. Dez. 2031	16.421
Zahlt Festzinssatz 1,70 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.481.000	NZD	15. Dez. 2026	12.002
Zahlt Festzinssatz 1,67 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.459.988.000	KRW	16. Dez. 2031	20.087
Zahlt Festzinssatz 6,11 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	46.670.000	ZAR	15. Dez. 2026	40.178
Erhält Festzinssatz 7,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.171.000	MXN	10. Dez. 2031	(31.646
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	725.000	USD	15. Dez. 2051	(73.164
Zahlt Festzinssatz 0,74 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.650.000	USD	15. Dez. 2026	50.814
Zahlt Festzinssatz 2,84 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	209.100.000	HUF	15. Dez. 2031	29.909
Zahlt Festzinssatz 2,52 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	947.875.000	HUF	15. Dez. 2023	12.393
Zahlt Festzinssatz 3,74 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Goldman Sachs	736.530.000	ZAR	28. Dez. 2028	(7.903
Zahlt Festzinssatz 1,58 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Deutsche Bank	1.619.147.000	KRW	15. Dez. 2026	18.579
Zahlt Festzinssatz 5,28 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	314.520.000	INR	15. Dez. 2026	(8.982
Erhält Festzinssatz 5,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	J.P. Morgan	1.279.379.000	COP	16. Mrz. 2027	(8.469
Erhält Festzinssatz 6,09 %		0 444 554 000		46.14 0000	(00.504
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.414.564.000	COP	16. Mrz. 2032	(29.681
Erhält Festzinssatz 5,40 %	G:: 1 D	105 101 000		46.14 0007	
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Citi Bank	136.494.000	INR	16. Mrz. 2027	2.099
Erhält Festzinssatz 1,73 %		4.550.000	71.6	46.5	(00.504
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	4.663.000	ILS	16. Dez. 2031	(20.604
Zahlt Festzinssatz 4,59 %	Manner Ct. 1	1 545 005 000	CLD	1E D 2021	407.656
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.515.905.000	CLP	15. Dez. 2031	107.656
Erhält Festzinssatz 4,04 %	Mannan Charles	F 717 0FF 000	CLD	1E D 2020	/265.646
Zahlt Variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5.717.055.000	CLP	15. Dez. 2026	(265.646)
Zahlt Festzinssatz 3,44 %	Morgan Ctanlay	7 200 620 000	CLP	1E Doz 2022	1 4 1 0 4 4
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7.288.630.000	CLP	15. Dez. 2023	141.014

					Nicht verliebenten
Passhvaihung	Kontrahent	Nonnwort	Währung	Fälligkeitsda-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
Beschreibung	Kontranent	Nennwert	Währung	tum	(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 0,53 %	Caldua a Carla	24.040.000	TI C	45 M. 2024	(0.220)
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	24.810.000	ILS	15. Mrz. 2024	(8.328)
Erhält Festzinssatz 4,46 %	Donk of America	00 731 000	TNID	15 Dec 2022	2 205
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Bank of America	99.731.000	INR	15. Dez. 2023	3.385
Zahlt Festzinssatz 2,07 % Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.720.000	PLN	16. Mrz. 2032	11.222
Zahlt Festzinssatz 2.53 %	Morgan Stanley	1.720.000	FLIN	10. WITZ. 2032	11.222
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	429.027.000	HUF	15. Dez. 2023	5.476
Zahlt Festzinssatz 4,88 %	Worgan Starticy	423.027.000	1101	13. DC2. 2023	5.470
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	BNP Paribas	3.068.228.000	COP	15. Dez. 2023	(295)
Zahlt Festzinssatz 4,87 %	2	5.000.220.000		. 5, 5 c2, 2 c2	(=33)
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	3.068.227.000	COP	15. Dez. 2023	(64)
Erhält Festzinssatz 0,13 %					(- 1)
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	24.385.000	USD	15. Dez. 2022	(27.078)
Zahlt Festzinssatz 0,28 %	,				, ,
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	18.405.000	USD	15. Dez. 2023	25.980
Erhält Festzinssatz 0,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	8.370.000	USD	15. Dez. 2024	(29.662)
Erhält Festzinssatz 6,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	72.926.000	MXN	13. Mrz. 2024	(26.931)
Zahlt Festzinssatz 3,12 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	12.429.000	MYR	20. Mrz. 2027	11.920
Zahlt Festzinssatz 1,04 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	J.P. Morgan	1.664.000	SGD	16. Mrz. 2027	25.341
Zahlt Festzinssatz 6,17 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	J.P. Morgan	292.457.000	INR	20. Mrz. 2027	(16.164)
Zahlt Festzinssatz 4,87 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	72.424.000	ZAR	16. Mrz. 2023	(133)
Zahlt Festzinssatz 0,03 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.345.000	EUR	20. Mrz. 2027	(295)
Zahlt Festzinssatz 9,88 %	10.14	44.040.444	DD1	2.1. 2024	(20.774)
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	11.040.111	BRL	2. Jan. 2024	(20.771)
Erhält Festzinssatz 3,31 %	Cradit Cuissa	930 706 000	CLD	10 Mrs 2021	(05.241)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 0,78 %	Credit Suisse	830.706.000	CLP	18. Mrz. 2031	(95.241)
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	25.123.000	SEK	17. Dez. 2030	40.751
Erhält Festzinssatz 0,45 %	Morgan Stanley	23.123.000	JLK	17. Dez. 2030	40.731
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.933.000	NZD	21. Dez. 2025	(93.236)
Zahlt Festzinssatz 1,05 %	e. ga etaey	2.333.000		2.1.2 02.1 2023	(55.255)
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	974.461.000	KRW	17. Dez. 2030	35.751
Erhält Festzinssatz 0,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.014.000	AUD	15. Mrz. 2026	(30.947)
Erhält Festzinssatz 1,11 %	- ,				,
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	492.000	ILS	18. Mrz. 2031	(5.827)
Zahlt Festzinssatz 0,55 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.749.000	SEK	18. Mrz. 2031	6.600

					Bilaha wasiisiswas
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)			_		
Zahlt Festzinssatz 0,60 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.510.000	SEK	18. Mrz. 2031	5.298
Zahlt Festzinssatz 7,58 %	. J				
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.605.000	ZAR	8. Nov. 2031	5.496
Erhält Festzinssatz 1,32 %	,				
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.609.000	AUD	18. Mrz. 2031	(51.445)
Erhält Festzinssatz 1,57 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	969.000	AUD	18. Mrz. 2031	(22.818)
Erhält Festzinssatz 1,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.214.000	AUD	18. Mrz. 2031	(58.950)
Erhält Festzinssatz 3,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.348.000	CLP	18. Mrz. 2031	(410)
Erhält Festzinssatz 3,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	6.005.000	CLP	18. Mrz. 2031	(587)
Zahlt Festzinssatz 1,33 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.082.000	NOK	21. Jun. 2026	18.215
Erhält Festzinssatz 2,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	377.000	AUD	17. Jun. 2031	(2.368)
Erhält Festzinssatz 2,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.230.000	AUD	17. Jun. 2031	2.665
Erhält Festzinssatz 2,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.995.000	AUD	17. Jun. 2031	3.867
Erhält Festzinssatz 2,39 %	Margan Stanlay	2 (40 000	ALID	17 lun 2021	F F0.4
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months Erhält Festzinssatz 1,80 %	Morgan Stanley	2.640.000	AUD	17. Jun. 2031	5.504
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	1.229.000	ILS	17. Jun. 2031	(3.093)
Erhält Festzinssatz 1,95 %	CILI DATIK	1.229.000	ILS	17. Juli. 2031	(3.093)
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	6.125.000	ILS	17. Jun. 2031	(2.273)
Erhält Festzinssatz 2,06 %	Goldman Sachs	0.123.000	123	17. juni 2001	(2.273)
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	2.351.000	ILS	17. Jun. 2031	2.911
Zahlt Festzinssatz 1,77 %				-	
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	718.932.000	KRW	17. Jun. 2031	7.097
Zahlt Festzinssatz 0,47 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	4.271.000	USD	21. Sept. 2023	61
Zahlt Festzinssatz 2,56 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.895.000	USD	16. Sept. 2031	20.219
Zahlt Festzinssatz 1,80 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.470.000	PLN	20. Sep. 2026	42.612
Erhält Festzinssatz 4,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.066.645.000	CLP	16. Sept. 2031	(64.393)
Zahlt Festzinssatz 2,72 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	12.528.000	AUD	16. Sept. 2031	(31.568)
Erhält Festzinssatz 4,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	1.248.581.000	CLP	16. Sept. 2031	(65.660)
Erhält Festzinssatz 3,20 %	Margar Ctarley	227 022 000		16 64-4 2024	(40.003)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	337.022.000	HUF	16. Sept. 2031	(19.893)

Pagalwaih	Vantuahant	Nammurant	\A/# b	Fälligkeitsda-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	tum	(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	226.559.000	CLP	16. Sept. 2031	(11.834)
Erhält Festzinssatz 7,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45.219.000	MXN	16. Sep. 2026	(28.688)
Zahlt Festzinssatz 1,43 %		4 220 260 000	LCDVA	24 6 4 2022	44.040
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4.229.269.000	KRW	21. Sept. 2023	11.940
Zahlt Festzinssatz 1,53 %	Margan Stanlay	2.840.000	LICD	20 5 2026	(1.007)
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.840.000	USD	20. Sep. 2026	(1.907)
Erhält Festzinssatz 1,44 %	Morgan Stanlov	12 007 000	DLN	21 Capt 2022	(0.975)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 4,95 %	Morgan Stanley	13.997.000	PLN	21. Sept. 2023	(9.875)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	280.811.000	CLP	16. Sept. 2031	(12.450)
Erhält Festzinssatz 3.16 %	Morgan Stanley	280.811.000	CLF	10. Sept. 2031	(12.430)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	338.958.000	HUF	16. Sept. 2031	(21.784)
Erhält Festzinssatz 2,19 %	Morgan Stanley	338.938.000	1101	то. зерг. 2031	(21.764)
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.095.000	NOK	16. Sept. 2031	6.194
Erhält Festzinssatz 3,25 %	Worgan Stanley	10.055.000	NOR	10. Sept. 2051	0.154
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.563.950.000	CLP	15. Sep. 2026	(425.415)
Zahlt Festzinssatz 4,02 %	e. ga etaey			.э. ээр. 2020	(1231113)
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	977.715.000	CLP	15. Sept. 2031	130.998
Zahlt Festzinssatz 2,46 %	. g				
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6.624.665.000	CLP	15. Sept. 2023	283.020
Zahlt Festzinssatz 4,35 %	,			·	
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	209.561.000	ZAR	15. Dez. 2022	16.498
Zahlt Festzinssatz 2,03 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	435.328.000	HUF	15. Dez. 2023	18.973
Zahlt Festzinssatz 1,74 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.747.088.000	HUF	15. Dez. 2022	86.467
Zahlt Festzinssatz 0,80 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	72.398.000	PLN	15. Dez. 2022	29.119
Zahlt Festzinssatz 0,34 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	13.419.000	ILS	15. Dez. 2023	3.262
Erhält Festzinssatz 1,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	73.833.000	CZK	15. Dez. 2023	(70.669)
Zahlt Festzinssatz 5,27 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	279.933.000	MXN	14. Dez. 2022	121.641
Erhält Festzinssatz 6,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	309.501.000	MXN	20. Dez. 2023	(131.065)
Erhält Festzinssatz 3,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.145.857.930	CLP	21. Dez. 2023	(16.917)
Zahlt Festzinssatz 7,52 %	David D	00.640.005	DLID	45.5	40.500
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	90.648.000	RUB	15. Dez. 2031	18.599
Zahlt Festzinssatz 1,84 %	Manager Ct. 1	44 205 000	NOY	1F D 2021	40.04=
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	41.295.000	NOK	15. Dez. 2031	48.947
Zahlt Festzinssatz 0,84 %	Morgan Ctanlar	2 440 000	CEIV	1E Doz 2024	11 110
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.440.000	SEK	15. Dez. 2031	11.146

					Nicht realisierter
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Wertzuwachs/ (Wertverlust)
-	Romanana	. Tellimere	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	cam	(Wereverlase)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.) Erhält Festzinssatz 0,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	8.215.000	USD	15. Dez. 2023	(11.429)
Zahlt Festzinssatz 0,22 %	worgan starticy	0.213.000	030	13. DC2. 2023	(11.725)
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.134.000	EUR	15. Dez. 2026	(105.072)
Erhält Festzinssatz 7,26 %					(**************************************
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11.240.000	MXN	16. Mai 2041	(40.096)
Erhält Festzinssatz 2,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Bank of America	82.672.000	CNY	15. Sep. 2026	226.908
Erhält Festzinssatz 2,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	30.214.000	CNY	15. Sep. 2026	79.703
Erhält Festzinssatz 1,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.338.000	NZD	15. Dez. 2031	(30.925)
Zahlt Festzinssatz 0,97 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.723.000	NZD	21. Dez. 2023	9.864
Erhält Festzinssatz 1,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	4.793.000	AUD	15. Dez. 2031	(9.289)
Erhält Festzinssatz 1,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	15.796.000	CAD	15. Dez. 2026	(119.189)
Erhält Festzinssatz 2,00 %	Managar Chambri	105.000	CAD	15 D 2021	(2.520)
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	185.000	CAD	15. Dez. 2031	(3.539)
Erhält Festzinssatz 1,88 % Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	1.618.000	CAD	20. Dez. 2026	(5.878)
Erhält Festzinssatz 0,56 %	Worgan Stanley	1.018.000	CAD	20. Dez. 2020	(3.878)
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	13.211.000	SEK	20. Sep. 2026	(9.947)
Zahlt Festzinssatz 5,75 %	e. ga etae,	.5.2	52.1	20.000.2020	(3.3.7)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14.452.120	MXN	12. Jun. 2024	15.690
Zahlt Festzinssatz 4,92 %	. 5				
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36.314.124	MXN	17. Jun. 2022	8.656
Zahlt Festzinssatz 5,94 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	28.577.000	MXN	14. Jun. 2024	24.501
Erhält Festzinssatz 7,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.023.000	ZAR	15. Dez. 2031	(5.924)
Erhält Festzinssatz 7,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.505.000	ZAR	15. Dez. 2031	(5.426)
Erhält Festzinssatz 7,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	17.303.000	ZAR	15. Dez. 2031	(8.815)
Erhält Festzinssatz 7,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.530.000	ZAR	15. Dez. 2031	(12.613)
Erhält Festzinssatz 1,66 %	Managar Chambri	44 474 000	NOV	15 D 2026	(00.035)
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	41.171.000	NOK	15. Dez. 2026	(98.935)
Zahlt Festzinssatz 6,27 % Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12.985.000	ZAR	15. Dez. 2026	5.269
Zahlt Festzinssatz 6,27 %	worgan startiey	12.963.000		13. DEZ. 2020	5.209
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	5.802.000	ZAR	15. Dez. 2026	2.436
Zahlt Festzinssatz 2,13 %	morgan stainey	5.002.000		. 5. 502. 2020	2.730
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.886.000	USD	16. Dez. 2031	(148)
	ga stariney			. 5. 2 . 2. 2 . 5 . 1	(1.10)

					Altaba a altata a
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
	Kontranent	Weiliwert	waniang	tuiii	(Wertverlast)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 1,97 % Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	4.579.000	ILS	16. Dez. 2031	(5.167)
Zahlt Festzinssatz 2,25 %	Goldinan Sacris	4.579.000	ILS	16. Dez. 2031	(5.167)
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	539.663.000	HUF	15. Dez. 2023	16.296
Erhält Festzinssatz 3,05 %	Worgan Starticy	333.003.000	1101	15. DC2. 2025	10.230
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	40.074.000	HUF	16. Dez. 2031	(3.264)
Zahlt Festzinssatz 2,30 %	g				(=:==:,
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	665.592.000	HUF	15. Dez. 2023	17.695
Erhält Festzinssatz 0,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	BNP Paribas	8.454.000	ILS	21. Dez. 2023	(3.598)
Erhält Festzinssatz 0,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	6.752.000	ILS	21. Dez. 2023	(2.296)
Erhält Festzinssatz 2,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	11.056.000	CNY	15. Dez. 2023	10.666
Zahlt Festzinssatz 1,84 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	43.163.000	NOK	20. Dez. 2026	18.343
Erhält Festzinssatz 2,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	5.320.000	CNY	15. Dez. 2026	12.883
Zahlt Festzinssatz 5,59 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.258.000	MXN	28. Jun. 2022	1.097
Erhält Festzinssatz 6,10 %	Managa Chamler	25 002 500	N AVA I	27 1 2022	(2.726)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 6,36 %	Morgan Stanley	25.882.500	MXN	27. Jun. 2023	(3.726)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	41.261.375	MXN	25. Jun. 2024	15.041
Zahlt Festzinssatz 1,37 %	Morgan Starlley	41.201.373	IVIAIN	23. Jun. 2024	13.041
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	3.805.280.000	KRW	15. Dez. 2022	4.032
Zahlt Festzinssatz 7,14 %	24 01.7	5.005.200.000		. 5, 5 02, 2022	
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	23.483.515	MXN	9. Dez. 2026	1.916
Zahlt Festzinssatz 2,06 %	,				
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	42.644.000	CZK	15. Dez. 2026	60.900
Erhält Festzinssatz 0,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	9.208.000	ILS	20. Dez. 2026	(24.290)
Zahlt Festzinssatz 2,18 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	51.095.000	CZK	20. Dez. 2026	29.576
Erhält Festzinssatz 7,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	41.856.287	MXN	10. Dez. 2031	(21.934)
Erhält Festzinssatz 3,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	494.594.000	HUF	16. Dez. 2031	(38.965)
Erhält Festzinssatz 6,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.039.000	MXN	5. Jul. 2023	(2.230)
Erhält Festzinssatz 2,66 %	Coldman Cl	2.055.000	MVD	1E Do- 2020	(F.00C)
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	2.855.000	MYR	15. Dez. 2026	(5.896)
Erhält Festzinssatz 0,41 % Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	A 472 000	AUD	15. Dez. 2023	3.759
Erhält Festzinssatz 2,61 %	worgan stanley	4.473.000	AUD	13. Dez. 2023	5./59
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	44.938.000	CNY	15. Dez. 2023	39.153
Zame variablen Zinssacz etti Kei O KATE / Days	j.i . ivioi gaii	 .,,,,,,,,,,	CIVI	15, 502, 2025	33.133

					Nijelst verdiringster
Pagehya:huma	Vontunkont	Namourant	14/# b	Fälligkeitsda-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	tum	(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,51 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	7.278.000	ZAR	15. Dez. 2026	(1.857)
Zahlt Festzinssatz 6,48 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.954.000	ZAR	15. Dez. 2026	(2.583)
Erhält Festzinssatz 2,93 %	C::: D	40.605.000	CND	20 D 2026	40.04.4
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	40.605.000	CNY	20. Dez. 2026	48.014
Erhält Festzinssatz 0,61 % Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	1 514 000	TI C	15 Do- 2026	(6.791)
	Goldman Sachs	1.514.000	ILS	15. Dez. 2026	(6.781)
Erhält Festzinssatz 2,61 % Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	2.355.861	MYR	15. Dez. 2026	(6 197)
Erhält Festzinssatz 2,69 %	Balik Of Affierica	2.333.001	IVITK	15. Dez. 2026	(6.187)
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	9.176.000	CNY	15. Dez. 2026	11.641
Erhält Festzinssatz 7,58 %	J.F. Morgan	3.170.000	CIVI	13. Dez. 2020	11.041
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16.820.000	MXN	10. Dez. 2031	(10.973)
Erhält Festzinssatz 0,41 %	Worgan Starticy	10.020.000	1717	10. DC2. 2031	(10.575)
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.654.000	EUR	16. Dez. 2031	(32.081)
Erhält Festzinssatz 1,71 %	Worgan Starticy	3.034.000	LOIK	10. DC2. 2031	(32.001)
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	1.106.243.000	KRW	20. Dez. 2026	(8.083)
Zahlt Festzinssatz 1,77 %	Dank or / linerica			20, 202, 2020	(0.000)
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	50.396.000	CZK	15. Dez. 2026	103.252
Erhält Festzinssatz 7,51 %	. .				
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	41.676.000	MXN	10. Dez. 2031	(31.616)
Erhält Festzinssatz 7,49 %	3				
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.423.100	MXN	10. Dez. 2031	(21.538)
Erhält Festzinssatz 5,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11.033.000	ZAR	15. Dez. 2023	(1.354)
Erhält Festzinssatz 0,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.955.000	PLN	15. Dez. 2023	(18.252)
Erhält Festzinssatz 7,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	37.585.000	MXN	10. Dez. 2031	(34.570)
Erhält Festzinssatz 2,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	282.017.000	HUF	16. Dez. 2031	(29.096)
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	39.579.000	ZAR	15. Dez. 2023	(13.323)
Erhält Festzinssatz 4,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	92.350.000	ZAR	15. Dez. 2023	(29.945)
Erhält Festzinssatz 1,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18.782.000	NOK	15. Dez. 2026	(40.887)
Erhält Festzinssatz 0,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	23.652.000	ILS	15. Dez. 2022	(5.569)
Zahlt Festzinssatz 5,55 %			100		
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.269.000	MXN	26. Jul. 2022	3.631
Erhält Festzinssatz 6,00 %		60 16= ===	N 43/2 1	25 1 1 222	,,
Zahlt Sartsianata C 25 %	Morgan Stanley	63.407.500	MXN	25. Jul. 2023	(16.988)
Zahlt Festzinssatz 6,25 %	Maurice Ct.	45 400 000	AAVAI	22 101 2021	24.502
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45.430.000	MXN	23. Jul. 2024	24.583

				Fälligkeitsda-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	tum	(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,35 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.455.105.000	HUF	15. Dez. 2023	34.880
Erhält Festzinssatz 2,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.202.295.000	HUF	15. Dez. 2026	(101.931)
Zahlt Festzinssatz 2,67 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	320.655.000	HUF	15. Dez. 2031	61.790
Erhält Festzinssatz 2,57 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	3.175.000	MYR	15. Dez. 2026	(9.687)
Erhält Festzinssatz 5,08 %		744.000.000	G1 D	46.5	(00.75.4)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	744.930.000	CLP	16. Dez. 2031	(28.754)
Zahlt Festzinssatz 2,57 % Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Margan Stanley	455 242 000		15 Do- 2026	24.692
	Morgan Stanley	455.313.000	HUF	15. Dez. 2026	34.682
Erhält Festzinssatz 7,35 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11.400.000	MXN	5. Jul. 2041	(35.926)
Erhält Festzinssatz 1,51 %	worgan stanley	11.400.000	IVIAIN	3. Jul. 2041	(33.920)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.325.000	PLN	15. Dez. 2026	(51.599)
Zahlt Festzinssatz 1,78 %	worgan stanley	9.323.000	FLIN	13. Dez. 2020	(31.399)
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.350.000	PLN	15. Dez. 2031	27.386
Erhält Festzinssatz 5,82 %	worgan starticy	2.330.000	I LIV	13. DC2. 2031	27.300
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65.827.500	MXN	2. Aug. 2023	(28.223)
Erhält Festzinssatz 5,89 %				g	(=====)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65.827.500	MXN	31. Jul. 2023	(24.067)
Zahlt Festzinssatz 6,36 %	,			-	, ,
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.910.000	MXN	29. Jul. 2026	26.107
Zahlt Festzinssatz 6,41 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.910.000	MXN	27. Jul. 2026	23.940
Zahlt Festzinssatz 2,61 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	256.687.000	HUF	15. Dez. 2026	17.919
Erhält Festzinssatz 0,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	5.938.000	ILS	15. Dez. 2026	(30.925)
Zahlt Festzinssatz 1,03 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	35.365.000	PLN	15. Dez. 2023	70.977
Erhält Festzinssatz 7,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	39.147.182	MXN	10. Dez. 2031	(20.543)
Zahlt Festzinssatz 6,42 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	85.145.000	MXN	31. Jul. 2026	106.526
Erhält Festzinssatz 5,90 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	98.800.000	MXN	4. Aug. 2023	(36.339)
Zahlt Festzinssatz 6,43 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	28.400.000	MXN	31. Jul. 2026	35.243
Zahlt Festzinssatz 1,65 %	Many Ct 1	0.470.005	NZD	45.0	24.255
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.470.000	NZD	15. Dez. 2026	24.069
Zahlt Festzinssatz 1,69 %	Mayon Ctarley	1 (10 000	NZD	1E D 2026	42.646
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.610.000	NZD	15. Dez. 2026	13.616
Zahlt Festzinssatz 6,51 %	Morgan Stanlay	E6 70E 000	MYNI	3 VIII 2020	60.016
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	56.785.000	MXN	3. Aug. 2026	60.816

21113 344 aps (1 01 ts.)					
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierte Wertzuwachs (Wertverlust
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 6,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65.825.000	MXN	7. Aug. 2023	(18.537
Zahlt Festzinssatz 1,58 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.443.000	PLN	15. Dez. 2026	20.926
Zahlt Festzinssatz 2,30 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	HSBC	39.360.800	MYR	15. Dez. 2023	(780
Zahlt Festzinssatz 1,82 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.570.000	PLN	15. Dez. 2031	27.460
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.685.000	NZD	15. Dez. 2026	20.492
Zahlt Festzinssatz 2,34 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	633.000	NZD	16. Dez. 2031	6.467
Zahlt Festzinssatz 1,82 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.500.000	NZD	15. Dez. 2026	6.348
Zahlt Festzinssatz 1,75 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.815.000	PLN	15. Dez. 2031	22.18
Erhält Festzinssatz 7,75 %		40.500.000		40.5	45.70
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.620.000	MXN	10. Dez. 2031	(5.70)
Zahlt Festzinssatz 1,88 %	Managa Chambar	1 1 1 7 000	ALID	16 D 2021	17.04
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.147.000	AUD	16. Dez. 2031	17.94
Erhält Festzinssatz 7,68 %	Margan Stanlov	13.117.000	MXN	10. Dez. 2031	16.669
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 1,60 %	Morgan Stanley	15.117.000	IVIAIN	10. Dez. 2031	(6.668
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	3.338.920.000	KRW	16. Dez. 2031	54.753
Zahlt Festzinssatz 1,62 %	Goldman Sachs	3.330.320.000	KIKVV	10. DC2. 2031	54.75
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	1.001.676.000	KRW	16. Dez. 2031	15.696
Erhält Festzinssatz 2,68 %	J				
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	782.355.000	HUF	15. Dez. 2026	(46.418
Zahlt Festzinssatz 0,84 %	,				•
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.245.000	AUD	15. Dez. 2026	20.009
Zahlt Festzinssatz 0,44 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Citi Bank	4.270.000	SGD	15. Dez. 2023	14.596
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	3.666.650.000	KRW	16. Dez. 2031	44.50
Zahlt Festzinssatz 7,40 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Goldman Sachs	608.444.000	RUB	16. Mrz. 2024	64.183
Erhält Festzinssatz 2,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	7.588.000	MYR	16. Mrz. 2027	(13.09)
Zahlt Festzinssatz 3,34 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	9.473.639.000	CLP	16. Mrz. 2023	154.41
Zahlt Festzinssatz 0,30 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	BNP Paribas	6.520.000	ILS	16. Mrz. 2024	6.56
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	2.914.035.000	CLP	15. Dez. 2023	82.103
Zahlt Festzinssatz 3,44 %	cui p	0.0== .:=	G1 5		
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	2.872.405.000	CLP	15. Dez. 2023	79.239

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	2.268.985.000	CLP	15. Dez. 2026	(136.631)
Erhält Festzinssatz 4,03 %					, ,
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	2.270.605.000	CLP	15. Dez. 2026	(136.109)
Zahlt Festzinssatz 4,52 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	605.770.000	CLP	15. Dez. 2031	57.560
Zahlt Festzinssatz 4,52 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	627.405.000	CLP	15. Dez. 2031	59.766
Zahlt Festzinssatz -0,05 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 12 Months	Morgan Stanley	322.879.000	JPY	21. Mrz. 2027	14.138
Zahlt Festzinssatz 0,09 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 12 Months	Morgan Stanley	69.211.000	JPY	17. Mrz. 2032	4.604
Zahlt Festzinssatz 4,46 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.044.250.000	CLP	16. Dez. 2026	38.128
Zahlt Festzinssatz 4,45 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	477.003.000	CLP	15. Dez. 2026	17.710
Zahlt Festzinssatz 4,44 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	1.057.142.000	CLP	15. Dez. 2026	39.711
Zahlt Festzinssatz 1,62 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	1.889.318.000	KRW	15. Dez. 2026	18.637
Zahlt Festzinssatz 1,80 %		4 000 000		45.5	5.500
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.320.000	NZD	15. Dez. 2026	6.589
Zahlt Festzinssatz 4,45 %	Goldman Sachs	1 102 259 000	CLD	15 Doz 2026	40 GE 4
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 4,59 %	Goldman Sachs	1.102.258.000	CLP	15. Dez. 2026	40.654
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	1.091.283.000	CLP	15. Dez. 2026	31.821
Zahlt Festzinssatz 4,43 %	Dank of Afficienca	1.091.203.000	CLF	13. Dez. 2020	31.021
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	879.852.000	CLP	15. Dez. 2026	33.436
Zahlt Festzinssatz -0,47 %	Worgan Starriey	073.032.000	CLI	13. DC2. 2020	33.430
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.750.000	EUR	15. Dez. 2023	7.777
Erhält Festzinssatz -0,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.535.000	EUR	15. Dez. 2026	(65.812)
Zahlt Festzinssatz 0,03 %	3				, ,
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.140.000	EUR	15. Dez. 2031	56.274
Zahlt Festzinssatz 2,48 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.748.880.000	HUF	15. Dez. 2023	57.419
Erhält Festzinssatz 2,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.309.195.000	HUF	15. Dez. 2026	(112.119)
Zahlt Festzinssatz 2,97 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	618.790.000	HUF	15. Dez. 2031	66.002
Erhält Festzinssatz 1,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15.460.000	PLN	15. Dez. 2026	(51.623)
Zahlt Festzinssatz 1,93 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.685.000	PLN	15. Dez. 2031	120.592
Zahlt Festzinssatz 4,60 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	654.790.000	CLP	15. Dez. 2026	19.032

				Fälligkeitsda-	Nicht realisierter Wertzuwachs/
Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	tum	(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,88 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	96.645.000	ZAR	15. Dez. 2023	32.282
Zahlt Festzinssatz 6,02 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	120.460.000	ZAR	15. Dez. 2026	133.559
Erhält Festzinssatz 7,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	39.920.000	ZAR	15. Dez. 2031	(73.839)
Erhält Festzinssatz 2,75 %		2 762 702 002		45 D 2026	(424.070)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.762.780.000	HUF	15. Dez. 2026	(134.970)
Zahlt Festzinssatz 2,98 %	Mannan Chamler	1 500 405 000		15 D 2021	457.440
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.509.495.000	HUF	15. Dez. 2031	157.419
Zahlt Festzinssatz 0,28 % Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	12 510 000	ILS	15 Doz 2022	9.001
Erhält Festzinssatz 5,72 %	Golullian Sacris	13.519.000	ILS	15. Dez. 2023	8.001
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	204.048.000	ZAR	15. Mrz. 2024	(46.402)
Erhält Festzinssatz 7,57 %	Morgan Starlley	204.046.000	ZAR	13. 14112. 2024	(40.402)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	31.779.000	ZAR	16. Mrz. 2032	(45.447)
Erhält Festzinssatz 2,70 %	worgan starticy	31.773.000	27111	10. 1411 2. 2032	(43.447)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.869.574.000	HUF	15. Mrz. 2024	(19.598)
Zahlt Festzinssatz 4,49 %	worgan stamey	1.003.37 1.000	1101	13. 1411 2. 202 1	(13.330)
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.648.265.000	CLP	15. Dez. 2026	57.661
Erhält Festzinssatz 0,44 %	g				
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.625.000	AUD	16. Mrz. 2024	(1.549)
Zahlt Festzinssatz 1,00 %	j ,				
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.892.000	AUD	16. Mrz. 2027	19.383
Zahlt Festzinssatz 0,66 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.258.000	AUD	15. Mrz. 2024	5.006
Erhält Festzinssatz 1,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6.149.000	CAD	15. Mrz. 2024	(10.492)
Erhält Festzinssatz 1,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.611.000	CAD	16. Mrz. 2024	(16.484)
Erhält Festzinssatz 1,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	5.275.235.000	KRW	15. Dez. 2031	(76.389)
Erhält Festzinssatz 1,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.222.000	NZD	16. Mrz. 2024	(691)
Erhält Festzinssatz 9,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	28.850.000	ZAR	16. Dez. 2031	(13.407)
Zahlt Festzinssatz 2,01 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	215.000	PLN	15. Dez. 2031	1.391
Zahlt Festzinssatz 2,00 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.990.000	PLN	15. Dez. 2031	33.414
Erhält Festzinssatz 1,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.420.000	PLN	15. Dez. 2026	(17.772)
Erhält Festzinssatz 1,70 %	Manage Ct.	0.455.000	DLN	1F D 2025	/24 0023
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.455.000	PLN	15. Dez. 2026	(31.003)
Zahlt Festzinssatz 2,55 %	Morgan Ctanlay	1 206 000 000	шиг	1E Doz 2022	14740
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.286.889.000	HUF	15. Dez. 2023	14.743

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,76 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	2.068.081.000	CLP	15. Dez. 2026	41.847
Erhält Festzinssatz 1,73 %	Goldman Sacris	2.000.001.000	CLI	13. 502. 2020	11.017
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	10.265.119.000	KRW	15. Dez. 2026	(57.876)
Erhält Festzinssatz 1,03 %					(* ,
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	15.912.000	USD	16. Mrz. 2027	(134.890)
Zahlt Festzinssatz 1,41 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.852.000	USD	16. Mrz. 2032	49.533
Zahlt Festzinssatz 1,71 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	753.325.000	KRW	15. Dez. 2026	4.611
Zahlt Festzinssatz 1,69 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	1.674.050.000	KRW	15. Dez. 2026	11.864
Zahlt Festzinssatz 2,42 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.457.000	NZD	16. Dez. 2031	11.612
Zahlt Festzinssatz 0,42 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Bank of America	6.794.900	SGD	15. Dez. 2023	25.320
Erhält Festzinssatz 7,79 %		44424000	N 40/A 1	40 D 2024	(5.070)
Zahlt Sastrianasta 442 %	Morgan Stanley	14.134.000	MXN	10. Dez. 2031	(5.078)
Zahlt Festzinssatz 4,13 %	Margan Stanlov	1 527 071 000	CLP	15. Dez. 2023	17.278
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 4,10 %	Morgan Stanley	1.527.971.000	CLP	15. Dez. 2023	17.276
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	3.565.208.000	CLP	15. Dez. 2023	42.162
Erhält Festzinssatz 7,64 %	Dank of America	3.303.200.000	CLI	15. DC2. 2025	42.102
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	764.265.000	RUB	15. Dez. 2023	(47.959)
Zahlt Festzinssatz 1,92 %					(
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.880.000	NZD	15. Dez. 2026	1.937
Zahlt Festzinssatz 9,47 %	3				
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.675.000	ZAR	16. Dez. 2031	7.104
Zahlt Festzinssatz 9,57 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.507.000	ZAR	17. Mrz. 2032	4.531
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.329.000	NZD	16. Mrz. 2027	4.742
Zahlt Festzinssatz 2,16 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	3.286.000	CAD	17. Mrz. 2032	34.732
Erhält Festzinssatz 7,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	7.688.000	ZAR	16. Mrz. 2032	(6.302)
Erhält Festzinssatz 7,71 %		40.400.000	7.5	46.44 0000	(0.470)
Zahlt Sastrianasta 2.74 %	Morgan Stanley	10.432.000	ZAR	16. Mrz. 2032	(8.479)
Zahlt Festzinssatz 2,71 % Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Margan Stanlov	E63 366 000	шиг	16. Mrz. 2024	6 257
Erhält Festzinssatz 3,29 %	Morgan Stanley	563.366.000	HUF	16. WIFZ. 2024	6.357
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	252.269.000	HUF	16. Mrz. 2032	(8.418)
Erhält Festzinssatz 2,49 %	worgan stainey	232.203.000	7101	10. 1411 2. 2032	(0.710)
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	10.323.000	CNY	16. Mrz. 2027	(2.872)
Erhält Festzinssatz 2,50 %		. 5.525.666			(2.5, 2)
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	4.971.000	CNY	16. Mrz. 2027	(1.011)
	,				()

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,77 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	J.P. Morgan	30.686.000	RUB	16. Mrz. 2024	448
Zahlt Festzinssatz 2,54 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.207.000	PLN	17. Mrz. 2032	11.097
Zahlt Festzinssatz 6,39 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	42.305.000	ZAR	15. Dez. 2026	3.542
Zahlt Festzinssatz 6,40 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	89.060.000	ZAR	15. Dez. 2026	2.967
Zahlt Festzinssatz 5,81 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	204.100.000	MXN	27. Sept. 2022	3.445
Erhält Festzinssatz 6,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	202.695.000	MXN	26. Sept. 2023	(7.240)
Zahlt Festzinssatz 6,68 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	69.100.000	MXN	24. Sept. 2024	3.952
Zahlt Festzinssatz 2,00 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	1.169.972.000	KRW	16. Mrz. 2032	(1.534)
Erhält Festzinssatz 7,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	17.685.000	MXN	17. Sept. 2031	2.834
Erhält Festzinssatz 3,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.461.673.000	HUF	15. Mrz. 2024	
Erhält Festzinssatz 7,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	17.650.000	MXN	17. Sept. 2031	(460)
Zahlt Festzinssatz 2,79 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20.073.000	CZK	16. Mrz. 2027	(911)
				USD	1.479.884

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2021 gestaltete sich die Exponierung bei in Bezug auf Derivatkontrakte zu erhaltenden Sicherheiten je Kontrahent folgendermaßen:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA BlueTrend				
	Credit Suisse	Barmittel	THB	3.320.778
	Credit Suisse	Barmittel	USD	4.589.058
	HSBC	Barmittel	USD	80.000
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	6.111.965
	J.P. Morgan	Barmittel	MXN	4.690.807
	J.P. Morgan	Barmittel	NZD	261.478
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	9.725.754
			USD	21.980.515
Schroder GAIA Cat Bond				
	HSBC	Barmittel	USD	3.560.000
			USD	3.560.000
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
	HSBC	Barmittel	USD	240.000
			USD	240.000

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Egerton Equity				
	Merrill Lynch	Barmittel	CAD	4
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	126
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	13.403.885
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	7
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	49.601
Schroder GAIA Helix			EUR	13.446.823
Schiodel data Helix	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	3.542.572
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	4.425.530
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	967.140
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	13.240.992
	HSBC	Barmittel	USD	740.000
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	12.563
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	5.872.752
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	56.851
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2.559.053
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	221.602.195
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	6.913.666
			USD	40.294.469
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Credit Suisse	Barmittel	USD	90.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	3.390.000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	3.920.000
Saharday CATA Tura Signa Divaysified			USD	7.400.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Barmittel	EUR	1.305.242
	Credit Suisse	Barmittel	EUR	4.016.853
	Credit Suisse	Barmittel	JPY	33.937.404
	Credit Suisse	Barmittel	PLN	271.582
	Credit Suisse	Barmittel	THB	824.118
	HSBC	Barmittel	USD	670.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	216.168
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	20.110.468
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	14.528.290
	Societe Generale	Barmittel	AUD	6.955.491
	Societe Generale	Barmittel	GBP	8.032.105
	Societe Generale	Barmittel	SEK	7.985.976
	Societe Generale	Barmittel	SGD	808.300
	Societe Generale	Barmittel	TRY	3
	Societe Generale	Barmittel	USD	1.452.057
			USD	64.036.852
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	88.607
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
Schroder GAIA Wellington Pagosa			GBP	88.614
Schiodel GAIA Weilington Fagusa	Barclays Bank	Barmittel	USD	990.000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	20.000
	Citi Bank	Barmittel	USD	260.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	851.915
	Gordinan Sacis	Darritte	030	051.515

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)	HSBC	Barmittel	USD	146.210
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	659.000
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	530.000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	85.717
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	13.787
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	971.746
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	6.167
	Morgan Stanley	Barmittel	HUF	4.093
	Morgan Stanley	Barmittel	MXN	989.110
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	1.380
	Morgan Stanley	Barmittel	THB	95.588
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	2.927.493
			USD	7.643.176

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. Kosten für strukturierte Produkte sind im Marktwert enthalten.

Die Transaktionskosten für das Berichtsjahr fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA BlueTrend	USD	47.557
Schroder GAIA Cat Bond	USD	80.632
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	907.045
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	797.250
Schroder GAIA Helix	USD	1.166.628
Schroder GAIA M&A*	USD	3.049
Schroder GAIA Oaktree Credit*	USD	-
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	1.236.012
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	366.298
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	25.344
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	1.195.804

Dividenden

Während des Berichtsjahres haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividen- de-Tag	Zahlungs- datum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
9. Okt. 2020	16. Okt. 2020	23. Okt. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	226,18	USD	1,020023
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	428,54	SGD	1,349634
13. Nov. 2020	20. Nov. 2020	27. Nov. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	901,52	USD	4,065662
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.710,72	SGD	5,387570
11. Dez. 2020	18. Dez. 2020	28. Dez. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	850,70	USD	3,836475
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.105,06	SGD	5,099957
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	64.179,91	USD	11,740972
8. Jan. 2021	15. Jan. 2021	22. Jan. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	599,65	USD	2,704293
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.484,78	SGD	3,596859
12. Feb. 2021	19. Feb. 2021	26. Feb. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	728,12	USD	3,283666
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.366,42	SGD	4,387777

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



Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividen- de-Tag	Zahlungs- datum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
12. Mrz. 2021	19. Mrz. 2021	26. Mrz. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	619,67	USD	2,794579
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.793,74	SGD	3,762040
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	157.508,93	USD	11,870498
9. Apr. 2021	16. Apr. 2021	23. Apr. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	616,45	USD	2,780058
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.762,59	SGD	3,696483
14. Mrz. 2021	21. Mrz. 2021	28. Mrz. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	611,69	USD	2,758591
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.751,96	SGD	3,673943
11. Jun. 2021	18. Jun. 2021	25. Jun. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	427,73	USD	2,646343
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.679,44	SGD	3,521644
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	193.802,98	USD	11,173865
9. Jul. 2021	16. Jul. 2021	23. Jul. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	443,52	USD	2,744035
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.792,73	SGD	3,759063
13. Aug. 2021	20. Aug. 2021	27. Aug. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	610,74	USD	3,778620
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.401,98	SGD	5,036229
10. Sept. 2021	17. Sept. 2021	24. Sept. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	525,47	USD	3,251057
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.055,29	SGD	4,308963
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	239.137,14	USD	13,125441
29. Sept. 2021	30. Sept. 2021	13. Okt. 2021	Schroder GAIA BlueTrend Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	209,14	GBP	1,128583
			Schroder GAIA BlueTrend Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	99.806,79	GBP	0,831679

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 30. September 2021 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 1,15835 US-Dollar

1 Euro = 0,85969 Pfund Sterling

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 11. November 2021 wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelegt: Schroder GAIA Helix Klasse A Thes. (in SEK abgesichert) und Schroder GAIA Helix Klasse C Thes. (in SEK abgesichert).

Am 10. Dezember 2021 wurde die folgende Anteilsklasse aufgelegt: Schroder GAIA Cat Bond Klasse A Thes. (in EUR abgesichert).

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. ("BBH"), Verwahrstelle und Verwaltungsstelle der Gesellschaft, hat mit State Street Corporation ("State Street") eine Vereinbarung getroffen, wonach State Street das Investor Services-Geschäft von BBH übernimmt. Dieses umfasst die Dienstleistungen in den Bereichen Verwahrung, Fondsbuchhaltung und -verwaltung, Transferstelle, Verwahrstelle, Devisenhandel, Treuhand und Wertpapierleihe. Der Abschluss der Transaktion unterliegt den üblichen Abschlussbedingungen und der Zustimmung der Aufsichtsbehörden.

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performance- gebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performan- cegebühren auf Basis des durchschnittli- chen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performance- gebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performan- cegebühren auf Basis des durchschnittli- chen NIW
Schroder GAIA BlueTrend			Schroder GAIA Egerton Equity		
Klasse A Thes.	9.048	0,50 %	Klasse A Thes.	922.896	0,89 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	29.494	1,01 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	641.199	0,98 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Aussch. GBP	2.064	0,89 %
Klasse C Thes.	223.082	0,83 %	Klasse A1 Thes.	39.404	0,81 %
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	85.788	0,66 %	Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	153.084	0,90 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes.	4.479.139	1,09 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	882.515	1,35 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	89.513	0,22 %	Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	92.274	1,01 %
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	68	0,26 %	Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	3.327.913	1,34 %
Klasse E Thes.	95.610	1,09 %	Klasse C Aussch.	14.028	1,08 %
Klasse E Thes. CHF	31	1,65 %	Klasse C Aussch. GBP	27.025	1,05 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	158	1,25 %	Klasse E Thes.	3.636	1,05 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse E Thes. GBP	41	1,64 %	Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	entfällt#	entfällt#
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	181	1,47 %	Klasse X Thes.	698.612	0,97 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	98.774	0,59 %			
Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#	Schroder GAIA Helix		
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Thes.	15.175	1,58 %
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	967	0,56 %	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	633	1,46 %
-			Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	103.966	1,43 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity			Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	236	2,00 %
Klasse A Thes.	469.240	1,58 %	Klasse C Thes.	50.071	3,18 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2.893	1,09 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	241	1,98 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	99.404	1,46 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	693.201	1,81 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	3.931	1,21 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	132.421	1,78 %
Klasse A1 Thes.	82.411	1,87 %	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	263	2,19 %
Klasse C Thes.	2.863.384	1,82 %	Klasse C1 Thes.	39	2,26 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	42.145	1,40 %	Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	241	1,98 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1.912.123	1,59 %	Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	268	2,01 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	704.583	2,19 %	Klasse E Thes.	785.055	1,69 %
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	193.583	1,77 %	Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	25.278	1,29 %
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	265	1,89 %	Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	803.345	1,38 %
Klasse E Thes.	74.081	2,15 %	Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	135.259	1,45 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	7.904	1,82 %	Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	207	1,70 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	164.371	1,88 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	157.783	2,12 %	Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	entfällt#	entfällt#
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	128.768	1,93 %	Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	2.029.436	2,24 %
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	273	1,93 %			-
		+ 6 :: 11 + 11			

Für die Anteilsklasse werden keine Performancegebühren erhoben.

entfällt#

entfällt#



Klasse I Thes.

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

Martiel Ider Performance						
Klasse A Thes. 0 0,00 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 12,739 2,58 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 35,535 2,73 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 35,535 2,73 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 67,647 3,92 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse C Thes. (in USD abgesichert) 444 2,12 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 286 3,51 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 499,851 2,88 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 499,851 2,88 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse Thes. (in GHP abgesichert) 40 0,00 % Klasse A	Teilfonds und Anteilsklassen	Performance- gebühren je Anteilsklasse in	Anteil der Performan- cegebühren auf Basis des durchschnittli-	Teilfonds und Anteilsklassen	Performance- gebühren je Anteilsklasse in	Prozentualer Anteil der Performan- cegebühren auf Basis des durchschnittli- chen NIW
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.535 2,73 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 350.155 2,29 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in CBP abgesichert) 67.647 3,92 % Klasse C Thes. (in CBP abgesichert) 0 0,00% Klasse I Thes. (in USD abgesichert) 444 2,12 % Klasse C Thes. (in CBP abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 499.851 2,88 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 69.252 2,26 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 69.252 2,26 % Klasse L Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 10.53 3,50 % Klasse L Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 10.53 9,50 % Klasse L Thes. (in CHF abgesichert) 3.5 0,00 %	Schroder GAIA M&A*			Schroder GAIA UK Dynamic Absolute	e Return Fund	
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 350.155 2,29% Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in GUR abgesichert) 67.647 3,92% Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 444 2,12% Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00% Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) 286 3,51% Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69.252 2,26% Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 69.252 2,26% Klasse I Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00% Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 31.650 3,50% Klasse A Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00% Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 10 10 10 10 10 10 10 12 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10	Klasse A Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes.	12.739	2,58 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in USD abgesichert) 350.155 2,29% Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse C Thes. (in USD abgesichert) 67.647 3,92% Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) 444 2,12% Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00% Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) 449,9851 2,88% Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69.252 2,26% Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69.252 2,26% Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 69.252 2,26% Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00% Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 10.153 0,50% Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00% Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 98.771 0,77% Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 4.629 0,01% <	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	3.535	2,73 %
Klasse C Thes. (0) 0,00 % Klasse C Thes. (in USD abgesichert) 67.647 3,92 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0 0,00 % Klasse I Thes. (in EUR abgesichert) 444 2,12 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0 0,00 % Klasse K Thes. (in USD abgesichert) 286 3,5 1 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 49.851 2,88 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 60.252 2,26 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 0 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31.650 3,50 % Klasse I Thes. n 7/4 n/4 20.00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 10.533 3,50 % Klasse I Thes. n 10 m/4 n/4 20.00 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 10.533 1,26 % Klasse I Thes. n 10 m/4 n/4 20.058 Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 10.533 1,26 % Klasse I Thes. n 10 m/4 1,20 m/4	_	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	350.155	2,29 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) 444 2,12 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in USD abgesichert) 286 3,51 % Klasse E Thes. 0 0,00 % Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69.252 2,28 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69.252 2,2 6 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 31.650 3,50 % Klasse I Thes. n / a# n / a# n / a# Schroder GAIA Wellington Pagosa Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 1.053 0,50 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 420.658 0,33 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 190.323 1,26 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) </td <td></td> <td>0</td> <td>0,00 %</td> <td>Klasse C Thes. (in USD abgesichert)</td> <td>67.647</td> <td>3,92 %</td>		0	0,00 %	Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	67.647	3,92 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in LBR abgesichert) 244 2,12 % Klasse C Thes. (in (GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in USD abgesichert) 286 3,51 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69.252 2,26 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31.650 3,50 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31.650 3,50 % Klasse I Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 190.323 1,26 % Klasse A Thes. (in GBP abgesichert) 420.658 0,33 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 46.29 0,01 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20.185 1,38 % Klasse C Thes. (in GHP abgesichert) 3.850	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in USD abgesichert) 286 3,51 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69,252 2,28 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse I Thes. 0 0,00 % Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse I Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse A Thes. (in USD abgesichert) 10,0323 1,26 % Klasse A Thes. (in GBP abgesichert) 420,658 0,33 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 98,771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 4.629 0,01 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 20,046 Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 23,185 1,96 % Klasse C Thes.		0	0,00 %	Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	444	2,12 %
Klasse E Thes. 0 0,00 % Klasse R Thes. (in CHF abgesichert) 2,88 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in EUR abgesichert) 69,252 2,26 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse I Thes. n/a# n/a# Schroder GAIA Wellington Pagosa 190,323 1,26 % Klasse A Thes. Separation 420,658 0,33 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 10,53 0,50 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 45 0,00 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 98,771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 4,629 0,01 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20,046 1,07 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 4,629 0,01 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 20,3185 1,33 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 13,308 0,13 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 20,3185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 57,163 0,42 % Klasse C Thes. (in		0			286	3,51 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse A Thes. (in CBP abgesichert) 31,650 3,50 % Klasse I Thes. n/a# n/a# N/a# N/a# N/a# N/a# N/a# Klasse A Thes. (in CBP abgesichert) 10,0323 1,26 % Schroder GAIA Sirios US Equity Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 420,658 0,33 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 98,771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 20,046 1,07 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 4,629 0,01 % Klasse A Thes. (in SDa abgesichert) 20,046 1,07 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 3,850 0,13 % Klasse C Thes. (in BR abgesichert) 203,185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173,308 0,25 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 12,97,867 1,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 27,613 0,42 % Klasse C Thes. (in EUR abgesich		0	0,00 %	=	499.851	2,88 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31.650 3,50 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse R Thes. (in USD abgesichert) 31.650 3,50 % Klasse L Thes. n/a# n/a# Klasse A Thes. 40.058 190.323 1,26 % Schroder GAIA Sirios US Equity Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,01 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 20.3185 1,98 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 20.3185 1,98 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 1297.867 1,44 % Klasse E Thes. (in EUR a	Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	69.252	2,26 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Schroder GAIA Wellington Pagosa 190,323 1,26 % Klasse A Thes. 420,658 0,33 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 10,53 % 0,50 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 420,658 0,33 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 98,771 0,77 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 4629 0,00 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20,46 1,07 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 4,629 0,01 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20,46 1,07 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 3,850 0,13 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 20,3185 1,98 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173,308 0,25 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 203,185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 2,763 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1297,867 1,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 2,763 0,42 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 175 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 35,80		0		Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	31.650	3,50 %
Klasse A Thes. 190,323 1,26 % Schroder GAIA Sirios US Equity Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 1.053 0,50 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 20.3185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173.308 0,25 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 20.3185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,45 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 386 1,10 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 386 1,10 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,24 % Klasse C Thes. (in EUR abgesi		0	0,00 %	-		
Schroder GAIA Sirios US Equity Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 1.053 0,50 % Klasse A Thes. 420.658 0,33 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 4.629 0,01 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 4.629 0,01 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 20.3185 1,98 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 203.185 1,34 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,42 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in BUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 1.75 % 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 3.0 % Klasse C Thes. (in EUR abgesicher	Klasse I Thes.	n/a#	n/a#	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse A Thes. 420.658 0,33 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 4.629 0,01 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 15 0,96 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 1.019.391 0,64 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 4.318.376 1,98 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 173.308 0,25 % Klasse C Thes. (in GHF abgesichert) 73.294 0,46 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173.308 0,45 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 73.294 0,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 36 1,10 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 35.				Klasse A Thes.	190.323	1,26 %
Klasse A Thes. 420.658 0,33 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 98.771 0,77 % Klasse A Thes. (in CHF abgesichert) 35 0,00 % Klasse A Thes. (in SGD abgesichert) 20.046 1,07 % Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 4.629 0,01 % Klasse A Thes. 15 0,96 % Klasse C Thes. 1.019.391 0,64 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 4.318.376 1,98 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,64 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 203.185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173.308 0,25 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 73.294 0,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 31 1,85 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % <t< td=""><td>Schroder GAIA Sirios US Equity</td><td></td><td></td><td>Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)</td><td>1.053</td><td>0,50 %</td></t<>	Schroder GAIA Sirios US Equity			Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	1.053	0,50 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert) 4.629 0,01 % Klasse A1 Thes. 15 0,96 % Klasse C Thes. 1.019.391 0,64 % Klasse C Thes. 4.318.376 1,98 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 203.185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173.308 0,25 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 73.294 0,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 175 1,61 % Klasse I Thes. entfällt# Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 30.00 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 261.489 </td <td>• •</td> <td>420.658</td> <td>0,33 %</td> <td>Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)</td> <td>98.771</td> <td>0,77 %</td>	• •	420.658	0,33 %	Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	98.771	0,77 %
Klasse C Thes. 1.019,391 0,64 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 4.318,376 1,98 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 203.185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173.308 0,25 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 73.294 0,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. 2.850 0,86 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 175 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 58.144 1,14 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0,00 %	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	35	0,00 %	Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	20.046	1,07 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 3.850 0,13 % Klasse C Thes. (in BRL abgesichert) 203.185 1,34 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173.308 0,25 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 73.294 0,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. 2.850 0,86 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 175 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 31 1,85 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 58.144 1,14 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 58.144 1,14 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abge	Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	4.629	0,01 %	Klasse A1 Thes.	15	0,96 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 173.308 0,25 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 73.294 0,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. 2.850 0,86 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 175 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 31 1,85 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse X Thes. 15 1,01 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 58.144 1,14 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 261.489 1,24 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abgesicher	Klasse C Thes.	1.019.391	0,64 %	Klasse C Thes.	4.318.376	1,98 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 57.163 0,44 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 1.297.867 1,44 % Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. 2.850 0,86 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 175 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert) 386 1,10 % Klasse X Thes. 15 1,01 % Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 58.144 1,14 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 261.489 1,24 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 136.324 1,50 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. (in GBP abgesichert)	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	3.850	0,13 %	Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	203.185	1,34 %
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert) 2.763 0,42 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 809.331 1,60 % Klasse E Thes. 2.850 0,86 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 175 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C T Thes. (in CHF abgesichert) 31 1,85 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# klasse C 1 Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse X Thes. 15 1,01 % klasse C 1 Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 58.144 1,14 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 261.489 1,24 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 136.324 1,50 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) 162 1,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# ent	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	173.308	0,25 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	73.294	0,46 %
Klasse E Thes. 2.850 0,86 % Klasse C Thes. (in SGD abgesichert) 175 1,61 % Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 31 1,85 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse X Thes. 15 1,01 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 94.489 1,58 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 261.489 1,24 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 136.324 1,50 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) 162 1,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % ent	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	57.163	0,44 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1.297.867	1,44 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 16.931 0,37 % Klasse C1 Thes. 31 1,85 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert) 386 1,10 % Klasse X Thes. 15 1,01 % Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 94.489 1,58 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 261.489 1,24 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 136.324 1,50 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) 162 1,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse I Thes. entfällt# entfällt# entfällt# entfällt# entfällt# Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % entfällt# entfällt#	Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	2.763	0,42 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	809.331	1,60 %
Klasse I Thes. Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) O 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# Klasse K Thes. (in GBP abgesichert) O 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) O 0,00 % Klasse I Thes.	Klasse E Thes.	2.850	0,86 %	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	175	1,61 %
Klasse X Thes. 15 1,01 % Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert) 5.307 1,12 % Klasse X Thes. (in EUR abgesichert) 35.864 0,18 % Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 94.489 1,58 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 261.489 1,24 % Klasse C Thes. 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 136.324 1,50 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) 162 1,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse K Thes. 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % entfällt# entfällt#	Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	16.931	0,37 %	Klasse C1 Thes.	31	1,85 %
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)35.8640,18 %Klasse E Thes.94.4891,58 %Schroder GAIA Two Sigma DiversifiedKlasse E Thes. (in CHF abgesichert)58.1441,14 %Klasse C Thes.00,00 %Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)261.4891,24 %Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)00,00 %Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)136.3241,50 %Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)00,00 %Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)1621,46 %Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)00,00 %Klasse I Thes.entfällt#Klasse I Thes.entfällt#entfällt#Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)00,00 %Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)00,00 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#	Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	386	1,10 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert) 58.144 1,14 % Schroder GAIA Two Sigma Diversified Klasse E Thes. (in EUR abgesichert) 261.489 1,24 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 136.324 1,50 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) 162 1,46 % Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. (in SGD abgesichert) 162 1,46 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 %	Klasse X Thes.	15	1,01 %	Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	5.307	1,12 %
Schroder GAIA Two Sigma DiversifiedKlasse E Thes. (in EUR abgesichert)261.4891,24 %Klasse C Thes.00,00 %Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)136.3241,50 %Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)00,00 %Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)1621,46 %Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)00,00 %Klasse I Thes.entfällt#entfällt#Klasse I Thes.entfällt#entfällt#Klasse K Thes.00,00 %Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)00,00 %	Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	35.864	0,18 %	Klasse E Thes.	94.489	1,58 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) 136.324 1,50 % Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse E Thes. (in SGD abgesichert) 162 1,46 % E Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. (in GBP abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 %				Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	58.144	1,14 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert) Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) O 0,00 % Klasse I Thes. Klasse I Thes. (in GBP abgesichert) O 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# Klasse K Thes. O 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# Entfällt# Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) O 0,00 % Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) O 0,00 %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified			Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	261.489	1,24 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 % Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse I Thes. entfällt# Klasse K Thes. fun CHF abgesichert) 0 0,00 % controller entfällt# entfällt# entfällt# entfällt# entfällt# entfällt# o 0,00 % klasse K Thes. fun CHF abgesichert) o 0,00 %	Klasse C Thes.	0	0,00 %	Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	136.324	1,50 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) Klasse I Thes. entfällt# klasse K Thes. 0 0,00 % Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	162	1,46 %
Klasse I Thes. entfällt# entfällt# Klasse K Thes. 0 0,00 % Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 % 0,00 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %			
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert) 0 0,00 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#			
	Klasse K Thes.	0	0,00 %			
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert) 0 0,00 %	Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %			
	Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %			

 $F\ddot{u}r\ den\ Schroder\ GAIA\ Cat\ Bond\ und\ den\ Schroder\ GAIA\ Oaktree\ Credit \hbox{\star wird\ keine\ Performancegeb\"{u}hr\ berechnet.}$

^{*} Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. # Für die Anteilsklasse werden keine Performancegebühren erhoben.



Gesamtkostenquote ("TER") für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021

Teilfonds und Anteilsklassen	TER	Teilfonds und Anteilsklassen	TER
Schroder GAIA BlueTrend		Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)	
Klasse A Thes.	2,00 %	Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,03 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,71 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,03 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,71 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,03 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes.	1,40 %	Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	1,43 %	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,43 %	Klasse E Thes.	1,43 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %	Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,46 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %	Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,46 %
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,43 %	Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,46 %
Klasse E Thes.	1,40 %	Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	1,46 %
Klasse E Thes. CHF	1,34 %	Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	1,46 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,43 %	Klasse I Thes.	0,08 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %		
Klasse E Thes. GBP	1,40 %	Schroder GAIA Egerton Equity	
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %	Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	1,43 %	Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	2,46 %
Klasse I Thes.	0,07 %	Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	2,46 %
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %	Klasse A Aussch. GBP	2,43 %
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %	Klasse A1 Thes.	2,93 %
		Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	2,96 %
Schroder GAIA Cat Bond		Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse A Thes.	1,77 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,71 %
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	1,79 %	Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	1,69 %
Klasse C Thes.	1,38 %	Klasse C Thes. (in USD abgesichert) Klasse C Aussch.	1,71 % 1,68 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,40 %	Klasse C Aussch. GBP	1,68 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,41 %	Klasse E Thes.	1,68 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,41 %	Klasse I Thes.	0,13 %
Klasse F Thes.	1,73 %	Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	0,16 %
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	1,73 %	Klasse X Thes.	1,57 %
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	1,73 %	Masse A Tiles.	1,57 70
Klasse F Aussch.	1,73 %	Schroder GAIA Helix	
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1,73 %	Klasse A Thes.	2,45 %
Klasse I Thes.	0,15 %	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46 %
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	0,16 %	Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,47 %
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	0,18 %	Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,46 %
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	0,18 %	Klasse C Thes.	1,39 %
Klasse IF Thes.	1,32 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,41 %
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	1,33 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,42 %
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	1,33 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,44 %
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	1,33 %	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,42 %
Klasse IF Aussch.	1,32 %	Klasse C1 Thes.	1,36 %
	· · ·	Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	1,41 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity		Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	1,40 %
Klasse A Thes.	2,43 %	Klasse E Thes.	1,00 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,47 %	Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,00 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46 %	Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,00 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,46 %	Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,00 %
Klasse A1 Thes.	2,93 %	Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0,99 %

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



Gesamtkostenquote (die "TER") für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	TER
Schroder GAIA Helix (Forts.)	
Klasse I Thes.	0,15 %
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	0,17 %
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	0,78 %
Schroder GAIA M&A*	
Klasse A Thes.	1,63 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	1,75 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	1,74 %
Klasse C Thes.	0,90 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,01 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,01 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,01 %
Klasse E Thes.	0,65 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0,77 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0,76 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0,77 %
Klasse I Thes.	0,15 %
Schroder GAIA Oaktree Credit*	4.40.0/
Klasse A2 Thes.	1,40 %
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	1,61 %
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	1,59 %
Klasse C Thes.	0,91 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,11 %
Klasse C Thes. (in CRR abgesichert)	1,09 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert) Klasse E Thes.	1,10 %
	0,93 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0,96 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0,96 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert) Klasse I Thes.	0,95 % 0,15 %
	0,13 %
Schroder GAIA Sirios US Equity	2 42 0/
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,71 %
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,71 %
Klasse E Thes.	1,37 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,41 %
Klasse I Thes.	0,16 %
Klasse X Thes.	1,50 %
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	1,60 %

Teilfonds und Anteilsklassen	TER
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Klasse C Thes.	1,83 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,86 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,86 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,86 %
Klasse I Thes.	0,08 %
Klasse K Thes.	2,33 %
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	2,36 %
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	2,36 %
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	
Klasse C Thes.	1,16 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,18 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,18 %
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	1,19 %
Klasse I Thes.	0,08 %
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	1,69 %
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	1,71 %
Klasse R Thes.	1,21 %
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	1,22 %
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	1,23 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,46 %
Klasse A1 Thes.	2,86 %
Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,67 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,70 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,72 %
Klasse C1 Thes.	1,66 %
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	1,71 %
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	1,74 %
Klasse E Thes.	1,18 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,21 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,21 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,21 %
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	1,22 %
Klasse I Thes.	0,09 %

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

zugrundeliegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.
* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.



Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

Risikoprofil und Hebelung

1. Commitment-Ansatz

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

Fonds

Schroder GAIA Sirios US Equity

Schroder GAIA Cat Bond

Schroder GAIA Oaktree Credit*

2. Absoluter VaR-Ansatz

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

Teilfonds

Schroder GAIA BlueTrend

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Schroder GAIA Egerton Equity

Schroder GAIA Helix

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Schroder GAIA Wellington Pagosa

	Verwendung des aufsichtsrechtlichen VaR-Limits			
Teilfonds	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	Durchschnittliche Hebelung
Schroder GAIA BlueTrend	24,70 %	73,16 %	45,95 %	1894,90 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	39,53 %	89,27 %	55,79 %	177,10 %
Schroder GAIA Egerton Equity	35,27 %	70,97 %	47,35 %	147,00 %
Schroder GAIA Helix	9,65 %	19,84 %	13,87 %	597,80 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	23,54 %	49,80 %	33,05 %	517,50 %
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	15,10 %	37,20 %	22,33 %	113,80 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	7,69 %	23,75 %	15,20 %	798,00 %

Angaben zum VaR-Modell

Teilfonds	Modelltyp	Konfidenzintervall	Haltedauer Be	obachtungszeitraum
Schroder GAIA BlueTrend	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Contour Tech Equity**	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Egerton Equity**	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Helix	Parametrische Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Two Sigma Diversified**	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund**	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Wellington Pagosa**	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre

^{**} Der Beobachtungszeitraum wurde zum 1. Juli 2021 auf 3 Jahre aktualisiert.



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

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

OGAW-Vergütungsangaben für die Schroder Investment Management Europe S.A. ("SIM Europe") für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und Abschlusses und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 75 bis 102 des Jahresberichts und Abschlusses für 2020 (verfügbar auf der Website der Gruppe – https://www.schroders.com/en/investor-relations/results-and-reports/annual-report-and-accounts-2020/) gelesen werden, der weitere Informationen zu den Aktivitäten unseres Vergütungsausschusses und zu unseren Vergütungsgrundsätzen und -richtlinien bietet.

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

Der Vergütungsausschuss der Schroders plc hat eine Vergütungsrichtlinie aufgestellt, um sicherzustellen, dass die Anforderungen der OGAW-Richtlinie für alle OGAW-MRTs eingehalten werden. Der Vergütungsausschuss und der Verwaltungsrat der Schroders plc prüfen die Vergütungsstrategie mindestens jährlich. Der Verwaltungsrat der SIM Europe ist für die Verabschiedung der Vergütungsrichtlinie, die Prüfung ihrer allgemeinen Grundsätze mindestens einmal jährlich, für die Beaufsichtigung ihrer Umsetzung und für die Sicherstellung der Einhaltung der maßgeblichen lokalen Rechtsvorschriften verantwortlich. Die Vergütungspolitik wurde im Jahr 2020 überprüft, um sicherzustellen, dass sie mit den OGAW/AIFMD-Vergütungsanforderungen konform ist, und es wurden keine erheblichen Änderungen vorgenommen.

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

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

Die nachstehenden Vergütungsdaten spiegeln die im Jahr 2020 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 317 Mitarbeiter gezahlten Vergütung belief sich auf 52,35 Mio. EUR, wovon 32,93 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 19,42 Mio. EUR auf variable Vergütungen (z. B. Jahresbonuszahlungen oder aufgeschobene Bonuszahlungen) entfielen. Mitarbeiter anderer Unternehmen der Schroders-Gruppe, die im Verwaltungsrat der SIM Europe sitzen, erhalten für ihre Rolle als Verwaltungsratsmitglieder der SIM Europe keine zusätzliche Vergütung.
- Die nachstehenden Angaben beziehen sich auf OGAW-MRTs der SIM Europe. Die meisten dieser OGAW-MRTs waren bei anderen Unternehmen der Schroders-Gruppe beschäftigt. Dazu gehören auch Anlageverwaltungsdienste oder andere Aufgaben, die von der SIM Europe an andere Unternehmen der Schroders-Gruppe oder Dritte übertragen wurden. Viele dieser OGAW-MRTs erbringen auch Dienstleistungen für andere Konzernunternehmen von Schroders sowie andere Kunden. Aus Transparenzgründen spiegeln die nachfolgenden Gesamtvergütungszahlen die gesamte Vergütung für jeden SIM Europe OGAW-MRT wider. Die an die 216 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 gezahlte und der SIM Europe oder den von ihr verwalteten alternativen Investmentfonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 180,01 Mio. EUR, wovon 41,92 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 132,83 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW übernehmen, und 5,26 Mio. EUR an andere OGAW-MRTs, einschließlich MRTs mit Kontrollfunktionen, gezahlt wurden. Diese Gesamtvergütungswerte umfassen Beträge, die ggf. von Beauftragten gezahlt wurden.

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

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäß Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäß Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total-Return-Swaps für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 nachfolgend detailliert aufgeführt:

Schroder GAIA Egerton Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
27.594.448	2,91 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
24.495.144	2,58 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
52.089.592	5,49 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2021 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	19.099.672
Morgan Stanley	16.371.304
J.P. Morgan	10.622.951
Merrill Lynch	5.907.769
UBS	87.896
	52.089.592

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert EUR
Barmittel	13.446.710
	13.446.710

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
Weniger als 1 Tag	13.446.710
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	13.446.710

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	13.446.710
	13.446.710

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	19.442.353	1.838.778	21.281.131
3 bis 12 Monate	847.400	2.467.958	3.315.358
Mehr als 1 Jahr	7.304.695	20.188.408	27.493.103
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	27.594.448	24.495.144	52.089.592

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
UBS	Schweiz

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	13.446.710
	13.446.710

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	27.233.768
Gepoolt	-
Sonstige	-
	27.233.768

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.



Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite EUR*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	86,40 %	111.793.002
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	13,60 %	17.598.082
	100,00 %	129.391.084

^{*} Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in "Nettoertrag 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.

Schroder GAIA Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
-	-
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
35.926.779	4,91 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
35.926.779	4,91 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Goldman Sachs	25.967.501
J.P. Morgan	9.959.278
	35.926.779

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	11.990.000
	11.990.000



Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	11.990.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	11.990.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	11.990.000
	11.990.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	23.464.780	23.464.780
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	12.461.999	12.461.999
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	_	35.926.779	35.926.779

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Goldman Sachs	11.990.000
	11.990.000



Schroder GAIA Helix (Forts.)

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	9.780.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	9.780.000

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 das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	88,02 %	152.813.857
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	11,98 %	20.789.295
	100,00 %	173.603.152

^{*} Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in "Nettoertrag 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.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
3.502.822	1,03 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
8.405.710	2,49 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
11.908.532	3,52 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.



Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	4.970.423
Goldman Sachs	4.307.910
Merrill Lynch	1.784.250
Credit Suisse	845.949
	11.908.532

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	3.920.000
	3.920.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	3.920.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	3.920.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	3.920.000
	3 920 000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	3.073.911	7.729.945	10.803.856
Mehr als 1 Jahr	428.911	675.765	1.104.676
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	3.502.822	8.405.710	11.908.532

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA
Goldman Sachs	USA
Merrill Lynch	USA
Credit Suisse	Schweiz

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	3.920.000
	3.920.000

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2021 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

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

Rendite und Kosten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	95,01 %	67.473.343
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	4,99 %	3.546.270
	100,00 %	71.019.613

^{*} Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in "Nettoertrag 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.

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
9.790.355	1,08 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
-	-
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
9.790.355	1,08 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	9.790.355
	9.790.355

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2021 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Zum 30. September 2021 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung von Sicherheiten

Zum 30. September 2021 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	9.790.355	-	9.790.355
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	9.790.355	-	9.790.355

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.



Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2021 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	34.100.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	34.100.000

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 das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	11,17 % 100,00 %	5.943.202 53.187.980
Realisierter Nettoverlust	88,83 %	47.244.778
Nettozinsen auf Swaps	-	-
	% der Gesamtrendite	Rendite USD*

^{*} Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in "Nettoertrag 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

 $\label{thm:continuous} \mbox{Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.}$

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
6.058.282	1,47 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
8.119.755	1,97 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
14.178.037	3,44 %



Schroder GAIA Wellington Pagosa

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	5.146.462
Goldman Sachs	4.840.484
Morgan Stanley	4.191.091
	14.178.037

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	1.345.000
	1 345 000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	1.345.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	1.345.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1.345.000
	1.345.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	9.403	56.456	65.859
3 bis 12 Monate	441.592	271.858	713.450
Mehr als 1 Jahr	5.607.287	7.791.441	13.398.728
Unbegrenzte Laufzeit	_	-	-
	6.058.282	8.119.755	14.178.037

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	820.000
J.P. Morgan	284.000
Goldman Sachs	241.000
	1.345.000

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	2.567.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	2.567.000

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 das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	87,16 %	22.741.061
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	12,84 %	3.350.576
	100,00 %	26.091.637

^{*} Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in "Nettoertrag 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 III - Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)

Schroder GAIA Helix (der "Fonds") weist ökologische und/oder soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor ("SFDR") auf. Insbesondere fördert der Fonds folgendes Merkmal: Er weist basierend auf den Ratingkriterien des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf. Der Nachhaltigkeitswert wird mit dem von Schroders entwickelten Tool SustainEx™ gemessen, das eine Schätzung der potenziellen gesellschaftlichen oder ökologischen Auswirkungen liefert, die ein Emittent verursachen könnte. Dazu werden für jeden Emittenten bestimmte Metriken verwendet. Die positiven (z. B. Zahlung "fairer Löhne") und negativen (z. B. der von einem Emittenten emittierte Kohlenstoff) Auswirkungen werden für jede Metrik quantifiziert, um eine aggregierte Kennzahl zu ermitteln, die als fiktiver Prozentsatz des Umsatzes des jeweiligen Basisemittenten ausgedrückt wird. Ein Emittent kann ein Unternehmen oder ein Staat sein. Der Anlageverwalter überwacht die Einhaltung dieses Merkmals anhand des gewichteten durchschnittlichen Nachhaltigkeitswerts des Fonds in SustainEx™ im vergangenen Halbjahr. Der Fonds weist basierend auf der oben erläuterten Methodik des Anlageverwalters seit dem Datum des Inkrafttretens der aufsichtsrechtlichen Bestimmungen am 10. März 2021 einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf.

SustainEx™ deckt von Zeit zu Zeit möglicherweise nicht alle Beteiligungen des Fonds ab. In diesem Fall kann der Anlageverwalter alternative Methoden zur Bewertung relevanter Beteiligungen an dem Fonds einsetzen. Darüber hinaus werden bestimmte Arten von Vermögenswerten (z. B. Barmittel und bestimmte gleichwertige Wertpapiere wie Gilts) als neutral behandelt und daher von unseren proprietären Tools nicht berücksichtigt.



Schroder Investment Management (Europe) S.A. 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg Großherzogtum Luxemburg Tel.: (+352) 341 342 212 Fax: (+352) 341 342 342

GAIA 30. September 2021 DEDE