



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Halbjahresbericht

31. März 2024

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

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

Dieses Material darf nicht in Ländern ausgegeben werden, in denen dies gesetzlich verboten ist, und es darf nicht in einer Weise verwendet werden, die gegen lokale Gesetze oder Vorschriften verstößt.

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

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

Inhalt

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland	5
Verwaltungsrat	6
Verwaltung	7
Bericht des Verwaltungsrats	8
Bericht des Anlageverwalters	10
Statistische Informationen	11
Nettovermögensaufstellung	19
Ertrags- und Aufwandsrechnung	21
Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens	23
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	25
Anlageportfolio	29
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	29
Schroder GAIA BlueTrend	30
Schroder GAIA Cat Bond	31
Schroder GAIA Contour Tech Equity	37
Schroder GAIA Egerton Equity	37
Schroder GAIA Helix	38
Schroder GAIA Oaktree Credit	43
Schroder GAIA SEG US Equity	51
Schroder GAIA Sirios US Equity	52
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	53
Schroder GAIA Wellington Pagosa	54
Anmerkungen zum Abschluss	60
Gesamtkostenquote („TER“)	143
Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	146

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland

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

HSBC Continental Europe, Luxembourg

18, Boulevard de Kockelscheuer

L-1821 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 Aufwendererstattungen 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**

Non-Executive Director

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
1914 FRN
Malta

Weitere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche Garcia-Minaur**

Global Head of Wealth, Client Group

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

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

- **Bernard Herman**

Independent Director

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

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof
L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

- **Ross Leach**

Specialist Solutions

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

- **Tim Boole**

Head of Product Management Private Equity

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

- **Yves Francis¹**

Independent Director

67 rue du Pannebourg
6700 Arlon
Belgien

¹ Yves Francis wurde am 28. März 2024 in den Verwaltungsrat berufen.

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptbuchstelle, Registerführer und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg

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

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, L-1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Abschlussprüfer

KPMG Audit S.à r.l.

39, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

Contour Asset Management, LLC

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

Egerton Capital (UK) LLP

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

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

- Egerton Capital (US), LP.

Oaktree Capital Management, LP

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

Oaktree Capital Management, LP. hat den folgenden Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA Oaktree Credit bestellt:

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

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

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

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

Schroder Investment Management (Singapore) Ltd

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

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

Select Equity Group LP

380 Lafayette Street, New York, NY 10003, USA
Schroder GAIA SEG US Equity

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

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

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

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

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

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

- Wellington Management Company LLP.

Bericht des Verwaltungsrats

Die Gesellschaft

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

Schroders ist eine FATCA-konforme Organisation. Die FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft und ihre GIIN lauten wie folgt: FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft: FFI; Sponsoring-Gesellschaft: Schroder Investment Management (Europe) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“); GIIN der Sponsoring-Gesellschaft: 4RIMT7.0000.SP.442.

Abschluss

Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den Abschluss für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024 vor.

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

Dieser Bericht bezieht sich auf den Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024. Der letzte Termin, an dem die Anteilsurse berechnet wurden, war der 28. März 2024, der letzte Arbeitstag im Berichtszeitraum. Der Abschluss wurde im Einklang mit den luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) erstellt.

Zum 31. März 2024 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5.357.560.536 EUR, was im Vergleich zu 4.928.621.911 EUR zum 30. September 2023 einem Anstieg von 8,70 % entspricht.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

Die Verantwortung des Verwaltungsrats richtet sich nach luxemburgischem Recht. In Bezug auf den Abschluss der Gesellschaft ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Abschluss zu erstellen, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft und jedes ihrer Teilfonds zum Ende des Geschäftsjahres sowie des Ergebnisses der Gesellschaft und jedes ihrer Teilfonds für das Geschäftsjahr vermittelt.

Der Verwaltungsrat hat folgende Pflichten:

- Auswahl zweckdienlicher Rechnungslegungsmethoden und deren einheitliche Anwendung;
- Vornahme angemessener und umsichtiger Beurteilungen und Schätzungen;
- Angabe, ob diese in Übereinstimmung mit den anwendbaren Rechnungslegungsstandards erstellt wurden, Identifizierung dieser Standards und Erläuterung der Auswirkung und der Gründe für etwaige wesentliche Abweichungen von diesen Standards; und
- Erstellung des Abschlusses auf der Grundlage der Unternehmensfortführung, es sei denn, es ist unangemessen anzunehmen, dass die Fonds ihre Geschäftstätigkeit fortsetzen werden.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, sicherzustellen, dass angemessene Buchhaltungsunterlagen geführt werden. In diesem Zusammenhang hat er die Vermögenswerte der Fonds Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrung anvertraut. Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, Maßnahmen zu ergreifen, die ihm vernünftigerweise zur Verfügung stehen, um Betrug und andere Unregelmäßigkeiten zu verhindern und aufzudecken.

Verwaltungsratssitzungen

Während des Berichtszeitraums vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024 fanden vier Verwaltungsratssitzungen statt.

Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

1. Ihren Verpflichtungen gemäß der OGAW-Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009, die in luxemburgisches Recht umgesetzt wurde und am Geschäftssitz der Gesellschaft in der 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Großherzogtum Luxemburg zur Einsichtnahme verfügbar ist.
2. Ihrer Satzung, die am Geschäftssitz der Gesellschaft sowie im luxemburgischen Handelsregister, dem Registre de Commerce et des Sociétés („RCSL“), zur Einsichtnahme verfügbar ist.
3. Den Verpflichtungen bezüglich der Verwaltung der Gesellschaft, wofür die Gesellschaft Schroder Investment Management (Europe) S.A. bestellt hat, die wiederum den Bestimmungen der Richtlinie 2010/43/EG über Verwaltungsgesellschaften und der Richtlinie 2011/61/EU über die Verwalter alternativer Investmentfonds unterliegt, die in luxemburgisches Recht umgesetzt wurden.
4. Dem vom Luxemburger Fondsverband (Association of the Luxembourg Fund Industry, „ALFI“) veröffentlichten Verhaltenskodex für luxemburgische Investmentfonds, dessen Grundsätze die Gesellschaft freiwillig übernommen hat.

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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

Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

Aktivitäten während des Berichtszeitraums

1. Neue Anteilsklassen

Während des Berichtszeitraums wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelegt:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse E Thes.	USD	USD	6. Dezember 2023
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	GBP	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	GBP	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes.	USD	USD	6. Dezember 2023
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse A Aussch.	USD	USD	8. Dezember 2023
Klasse Y3 Thes.	USD	USD	22. Dezember 2023
Klasse Y3 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	22. Dezember 2023
Klasse Y3 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	22. Dezember 2023

Wesentliche Ereignisse während des Berichtszeitraums

Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine wirkt sich weiterhin auf die Bewertung der von der Gesellschaft gehaltenen russischen Wertpapiere aus. Der Verwaltungsrat hat weiterhin angemessene Bewertungsgrundsätze in Übereinstimmung mit unseren Preisbildungsprozessen angewandt. Am Ende des Berichtszeitraums hielten die Teilfonds von Schroder GAIA keine Anteile an russischen Vermögenswerten.

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA
31. März 2024

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

Prägend für den Sechsmontszeitraum war die Inflationsentwicklung und der Wechsel der Erwartungen bezüglich des Zeitpunkts, an dem die großen Zentralbanken in der Lage sein würden, die Zinssätze zu senken.

Die US-Inflationsdaten von Ende 2023, die niedriger ausfielen als erwartet, stärkten die Ansicht am Markt, dass die Federal Reserve das Ende ihrer Zinserhöhungen erreicht habe und 2024 zu Zinssenkungen übergehen würde. Der Fed-Vorsitzende Jerome Powell wies darauf hin, dass die Zentralbank sich des Risikos bewusst sei, die Zinsen zu lange auf einem restriktiven Niveau zu halten.

Im weiteren Verlauf des Jahres 2024 erwies sich die Inflation jedoch als hartnäckiger als erwartet, und die Märkte mussten ihre Einschätzung sowohl des Zeitpunktes als auch des Ausmaßes der Zinssenkungen in den USA korrigieren. Während sie zur Jahreswende sechs oder sieben Zinssenkungen eingepreist hatten, ließ der „Dot-Plot“ vom März, aus dem die Erwartungen der politischen Entscheidungsträger in Bezug auf Zinssenkungen genauer abzulesen sind, in diesem Jahr nur auf drei Senkungen schließen.

In der Eurozone und in Großbritannien war die Situation ähnlich: Mit einer höher als erwarteten Inflation sanken die Aussichten auf eine Lockerung der Geldpolitik. Einen wichtigen Kontrast bildete jedoch Japan. Im März 2024 überarbeitete die Bank von Japan ihre geldpolitischen Maßnahmen, wobei sie nicht nur den negativen Zinsen ein Ende setzte, sondern auch einen kurzfristigen Zinssatz von 0,0 % bis 0,1 % festlegte. Außerdem gab die BoJ ihre Politik der Renditekurvenkontrolle auf. Diesen Maßnahmen waren höhere Inflationszahlen und Anzeichen höherer Lohnvereinbarungen in Japan vorausgegangen.

Bei den Schwellenländern ließen die gemischten Wirtschaftsdaten aus China nach wie vor darauf schließen, dass sich die Konjunktur von der pandemiebedingten Abkühlung der Vorjahre nur schleppend erholte, und die Konjunkturförderungen blieben überschaubar. Die laufende Immobilienkrise belastete weiterhin die Stimmung.

Auch geopolitische Risiken waren in diesem Berichtszeitraum beachtlich. Im Oktober kam es zu erneuten Kampfhandlungen im Nahen Osten. Die Investoren begannen auch, die zahlreichen Wahlen im Jahr 2024 in den Blick zu nehmen, insbesondere die Präsidentschaftswahlen in den USA. Nach dem Ausscheiden der wichtigsten Konkurrentin Nikki Haley im März wird Donald Trump voraussichtlich als Kandidat der Republikanischen Partei in das Rennen gehen.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Die globalen Aktienmärkte verzeichneten im Sechsmontszeitraum starke Zuwächse, obwohl bei der Inflation der Zielwert nicht erreicht wurde und die Aussicht auf Zinssenkungen in weitere Ferne rückte. Die Anleger konzentrierten sich stattdessen auf die Widerstandsfähigkeit der Wirtschaft, wo die USA den Daten zufolge wohl eine Rezession vermeiden könnte, und auf die Erwartung, dass die Zinsen letztlich fallen würden. Auch die Euphorie über das Potenzial künstlicher Intelligenz (KI) stützte die Aktienkurse.

Der MSCI World Index erzielte in US-Dollar gemessen im Berichtszeitraum eine Rendite von 21,3 %. Die US-Aktien lagen bei den Gewinnen an der Spitze, unterstützt durch starke Zuwächse bei einigen KI-Unternehmen.

Auch die japanischen Aktien entwickelten sich sehr gut, wobei die lokalen Indizes letztendlich die letzten Allzeithochs aus den späten 1980er Jahren überstiegen. Der Optimismus hinsichtlich Japans verbesserter Wirtschaftsleistung stützte die Aktienkurse ebenso wie Hinweise darauf, dass die japanischen Unternehmen auf die Forderung der Tokioter Börse reagieren, ihren Unternehmenswert zu verbessern.

Die Schwellenländer konnten nicht mit den Industrieländern mithalten. Der MSCI EM Index erzielte in US-Dollar gemessen eine Rendite von 10,4 %. Ein großer Nachzügler war China. Peru, Kolumbien und Polen waren hingegen die erfolgreichsten Märkte.

Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

Die Renditen an den wichtigsten Staatsanleihemärkten fielen bis zum Jahresende drastisch (was bedeutet, dass die Preise stiegen), da der abnehmende Inflationsdruck die Marktteilnehmer davon überzeugte, dass die Zinssätze ihren Höchststand erreicht hatten. Seit Beginn des neuen Jahres haben die Anleger jedoch ihre Erwartungen für Zinssenkungen abwärts korrigiert, woraufhin die Renditen entsprechend stiegen und die Preise fielen.

Die Rendite zehnjähriger US-Staatsanleihen sank in diesem Zeitraum von 4,57 % auf 4,20 %, obwohl robuste US-Wirtschaftsindikatoren die Hoffnung auf eine rasche Zinssenkung zunichte machten. Die Renditen auf zehnjährige japanische Staatsanleihen fielen geringfügig von 0,77 % auf 0,72 %. Die Bank of Japan hat zwar zum ersten Mal seit 17 Jahren die Zinsen erhöht, die Bankvertreter erklärten jedoch erneut, dass sie eine entgegenkommende Haltung beibehalten werde. Die Rendite für zehnjährige Gilts fiel von 4,44 % auf 3,93 %, als die britische Wirtschaft in der zweiten Jahreshälfte 2023 in eine Rezession abrutschte. Die zehnjährige Rendite deutscher SBundesanleihen sank aufgrund der anhaltenden Schwäche der Wirtschaftsindikatoren in der Eurozone von 2,84 % auf 2,30 %, während die fallenden Energiepreise einen Rückgang der Inflation signalisierten.

An den Kreditmärkten haben sich die Spreads sowohl bei US-amerikanischen als auch bei europäischen Unternehmensanleihen, insbesondere bei Hochzinsanleihen, deutlich verengt.

Der US-Dollar verzeichnete am Ende des Berichtszeitraums trotz einer Erholung nach einer starken Abwertung gegen Ende 2023 einen niedrigeren Kurs.

Ausblick

Die Inflation war im letzten Jahr stark rückläufig und hat den Zielwert der großen Zentralbanken fast wieder erreicht. Währenddessen übertrafen die Volkswirtschaften die Erwartungen bei einem stärkeren Anstieg der Zinssätze, als vor einem Jahr erwartet worden war.

Als die Inflation fiel, begannen die Zentralbanken, den Ton ihrer Mitteilungen umzustellen. Die Erwartungen auf Senkungen der Zinssätze im Laufe des Jahres steigen, es ist aber noch offen, wie stark die Lockerung ausfallen wird. Insbesondere in den USA musste der Markt angesichts der Widerstandsfähigkeit der Wirtschaft und des hartnäckigen Inflationsdrucks seine Erwartungen für bevorstehende Zinssenkungen revidieren.

Die Ökonomen von Schroders erwarten, dass die US-Notenbank die Zinsen erst im September senken wird. Eine Analyse der Risiken lässt geringere Kürzungen zu einem späteren Zeitpunkt erwarten.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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

Statistische Informationen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert						
zum 31. März 2024	21.812.615	348.672.006	3.114.288.558	187.069.749	459.932.155	282.166.682
Im Umlauf befindliche Anteile*						
zum 31. März 2024						
Klasse A Thes.	15	79.092	4.994	98.805	224.804	4.664
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1.488	-	2.920	-	100
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	281.609	55.180	22.601	-	114.959
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	7.805	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	100	-	-	77
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	4.291	-	140
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	305.877	-
Klasse A Aussch.	-	-	611	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	2.378	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	3.953	7.024	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	86.612	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	2.523	333.632	11.605	549.526	592.387	23.505
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	194.396	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	13.077	1.722	18.479	-	7.571
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	255.054	24.230	290.437	-	30.425
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	817.035	76.429	212.130	75.631	82.964
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	63.156	-	11
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	140
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	418.986	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	4.924	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	2.751	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	18.984	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	23.697	26.916	-	3.743	6	302.086
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	1.236	-	603
Klasse E Thes. EUR	15	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	5.000	-	19.338	-	974.267
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	149.482
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	193	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	119.659	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	10.184	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.157	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	5.502	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	286	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	440	-	-	-
Klasse I Thes.	100.015	-	226.714	-	-	112.850
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	28.230	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	12.670	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	-	149.139	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	90.722	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	455.871	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	7.835.656	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	14.248	-	-	-
Klasse IZ Thes.	15	-	-	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)						
zum 31. März 2024						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	15	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	92
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	244.400	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	32.061	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	45.065	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	27.390	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	50.755	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	63.808	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	277.397	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	15
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	104
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	1.615
Klasse X Thes.	-	-	-	-	7	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	577.655
Klasse X1 Thes.	11.855	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	163	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	2.005	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	46.423	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	13.103	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	552	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	387	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	113	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	29	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	22.665	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	71.065	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	40.828	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	250	-	-	-
Klasse Y3 Thes.	-	-	72.452	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	4.140	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	7.402	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 31. März 2024	75.757.984	362.323.747	188.839.621	384.635.318	318.239.997
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 31. März 2024					
Klasse A Thes.	-	-	528.402	-	94.816
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	2.296	-	6.812
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	60.255	-	139.824
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	16.695
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	8.482	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	108	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	108	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	109	-	-	-	-
Klasse C Thes.	478	16.937	302.099	1.228.855	1.132.656
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	81.467
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	821	625	9.488	20.874	81.606
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1.144	15.822	78.149	506.547	383.869
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	100	43.401	22.614	390.788	513.141
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	109	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	109	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	109	-	398	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	45
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	108
Klasse E Thes.	317.793	-	170	-	32.818
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	7.879
Klasse E Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	131.740	-	5.229	-	95.281
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	659	-	-	-	46.499
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	17	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	110	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	109	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	17.336	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	200.015	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	15.188	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)					
zum 31. März 2024					
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	901	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	21.243	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse K Thes.	-	15	-	362.323	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	100	-	590	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	100	-	41.263	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	44.027	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	40.583	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	297.576	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	15.870	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	556.319	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	10.057	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	308.212	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	200	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	236.690	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	37.761	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	2.631	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	3.198	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	15	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	68	-	-
Klasse X1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y3 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*						
zum 31. März 2024						
Klasse A Thes.	109,95	126,74	1.703,12	142,93	254,01	108,48
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	104,81	-	123,59	-	95,13
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	110,79	1.108,89	128,95	-	98,52
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	245,16	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	1.022,73	-	-	819,78
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	192,40	-	105,50
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	264,80	-
Klasse A Aussch.	-	-	1.011,83	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	241,98	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	141,31	235,82	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	252,49	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	110,85	131,93	1.730,70	149,95	277,90	114,28
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	166,08	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	109,51	1.257,16	131,41	-	100,65
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	114,73	1.367,14	134,90	-	103,96
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	125,98	121,98	114,28	265,95	110,20
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1.126,43	-	852,49
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	110,88
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	289,79	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	276,39	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	264,10	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	123,90	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5.671,50
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	103,19	135,50	-	152,15	275,66	117,53
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	132,42	-	103,14
Klasse E Thes. EUR	103,01	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	117,50	-	136,77	-	107,14
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	113,37
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1.131,82	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	127,24	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1.704,23	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.242,03	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.346,52	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1.165,56	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1.526,64	-	-	-
Klasse I Thes.	115,26	-	2.009,89	-	-	125,26
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.573,43	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.714,00	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	11.707,54	-	-	11.715,26
Klasse IF Thes.	-	-	1.777,13	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.390,93	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.514,21	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	1.045,10	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1.388,76	-	-	-
Klasse IZ Thes.	111,17	-	-	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)						
zum 31. März 2024						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	103,01	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	111,01
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	113,86	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	129,27	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	885,71	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.098,15	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.130,43	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	1.066,84	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	105,93	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	106,41
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	96,17
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	101,72
Klasse X Thes.	-	-	-	-	276,63	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	107,06
Klasse X1 Thes.	103,36	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	103,17	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	102,82	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	103,25	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	1.179,56	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.100,43	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.135,87	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	1.171,82	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.092,21	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.127,33	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	1.238,56	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.171,01	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.203,69	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	122,81	-	-	-
Klasse Y3 Thes.	-	-	1.034,96	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.023,74	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.030,95	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 31. März 2024					
Klasse A Thes.	-	-	183,44	-	117,31
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	202,95	-	100,42
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	156,78	-	104,40
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	158,23
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	108,41	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	99,04	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	102,15	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	104,29	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	97,18	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	106,23	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	102,84	-	-	-	-
Klasse C Thes.	109,35	119,79	194,34	148,41	121,84
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	161,54
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	100,44	115,81	212,63	126,43	104,60
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	103,63	117,99	166,11	132,00	108,47
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	107,58	118,95	178,39	140,61	92,62
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	104,40	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	97,34	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	106,41	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	102,99	-	178,37	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5.218,12
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5.441,64
Klasse E Thes.	109,67	-	211,06	-	126,12
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	100,88	-	-	-	107,94
Klasse E Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	104,12	-	180,46	-	112,15
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	108,02	-	-	-	95,75
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	104,46	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	97,38	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	106,45	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	103,06	-	-	-	-
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.	112,10	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	118,77	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
zum 31. März 2024					
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	115,64	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	118,14	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	118,18	-	-	-
Klasse K Thes.	-	118,19	-	143,73	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	115,13	-	122,50	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	116,68	-	127,70	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	117,64	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	180,51	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	154,10	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	176,99	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	138,55	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	182,66	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	146,63	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	282,13	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	105,08	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	246,95	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	187,70	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	129,62	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	1.824,23	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	128,94	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	176,16	-	-
Klasse X1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y3 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2024

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA E gerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	18.425.675	253.586.230	2.892.002.476	141.096.161	304.576.093	219.816.078
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	1.972.725	(7.948.006)	(31.318.900)	30.675.976	92.256.391	26.920.448
Wertpapiere zum Marktwert	20.398.400	245.638.224	2.860.683.576	171.772.137	396.832.484	246.736.526
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	(196.956)	1.452.002	(37.936.315)	(1.162.015)	(235.662)	(5.183.874)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	3.557.178	-	-	-	(745.133)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	16.125.871	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	(2.153.945)	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	14.316.604	(6.214.363)
aus Differenzkontrakten	(463.498)	1.605.706	-	(3.234.015)	-	8.614.601
	(660.454)	20.586.812	(37.936.315)	(4.396.030)	14.080.942	(3.528.769)
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	1.658.527	219.722	76.357.454	4.494.524	5.291.471	11.573.511
Bankguthaben	1.771.571	33.403.460	224.482.051	13.262.930	44.820.995	31.467.187
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	16.740.479	-	-	-	3.333.971
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	4.279	32.466.871	22.860.000	6.987.159	19.281.859	5.952.849
Forderungen aus Zeichnungen	-	602.378	-	24.806	7.348.660	454.399
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	56.238	-	366.905
Dividenden und Zinsforderungen	147.888	1.094.893	39.262.852	287.300	1.254.691	4.912.154
Erstattungsforderung des Fonds	-	358.944	34.219	-	-	14.027
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	10.000	270.000	8.209.610	160.000	-	279.661
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	30.000	390	-	270.000	339
Sonstige Forderungen*	43.936	1.273.927	-	280.326	-	1.088.572
SUMME VERMÖGENSWERTE	23.374.147	352.685.710	3.193.953.837	192.929.390	489.181.102	302.651.332
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	1.486.705	211.492	55.516.026	478.588	6.534.957	16.917.268
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	266	2.925.519	-	1.529.337	10.825.938	2.792.602
Fällige Managementgebühren	6.525	282.338	1.849.721	190.677	518.929	163.417
Fällige Performancegebühren	28.014	32.578	801.484	3.230.004	9.737.787	-
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	21.372	56.081	-	157.408	60.029	215.148
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	-
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	270.000	-
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	10.000	300.000	8.210.000	160.000	-	280.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen**	8.650	205.696	13.288.048	113.627	1.301.307	116.215
SUMME VERBINDLICHKEITEN	1.561.532	4.013.704	79.665.279	5.859.641	29.248.947	20.484.650
SUMME NETTOVERMÖGEN	21.812.615	348.672.006	3.114.288.558	187.069.749	459.932.155	282.166.682

* Die sonstigen Forderungen umfassen Forderungen aus Devisenkassageschäften und verschiedene andere Forderungen.

** Die sonstigen Verbindlichkeiten und Rückstellungen beinhalten Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften sowie Verbindlichkeiten aus Verwaltungs-, Depot- und sonstigen Gebühren.

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2024 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	72.915.147	269.493.094	142.960.612	5.164.828	256.791.593	4.264.581.633
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	632.939	44.555.150	30.394.669	(49.887)	13.052.758	193.185.970
Wertpapiere zum Marktwert	73.548.086	314.048.244	173.355.281	5.114.941	269.844.351	4.457.767.603
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	218.447	(2.436.701)	(130.000)	(1.839.052)	(1.812.359)	(45.679.258)
aus Kassageschäften	-	-	-	(6.722)	-	(6.231)
aus Terminkontrakten	(8.252)	-	-	298.496	(88.326)	2.793.681
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(20.506)	(19.007)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	19.872	(76.256)	14.895.015
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	17.580	16.295
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(222.717)	(206.439)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(358.791)	(2.329.087)
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(571.448)	4.972.679	(1.335.140)	11.398.430
aus Differenzkontrakten	-	10.708.847	-	-	-	15.972.231
	210.195	8.272.146	(701.448)	3.445.273	(3.896.515)	(3.164.370)
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	332.683	4.873.321	2.342.656	241.970.034	16.684.955	339.450.430
Bankguthaben	1.324.579	38.247.574	21.944.335	129.400.181	53.064.627	553.110.846
Termineinlagen	-	-	-	240.837.000	-	223.234.930
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	17.090.025	7.609.156	41.501.258
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	390.512	1.284.174	-	5.558.715	12.933.680	101.256.407
Forderungen aus Zeichnungen	36.681	156.614	702.964	2.248.534	637.706	11.857.241
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	6.738.956	-	-	1.504.070	8.032.784
Dividenden und Zinsforderungen	1.137.633	781.363	134.286	90.560	1.653.545	47.139.174
Erstattungsforderung des Fonds	-	32.995	-	-	-	408.013
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	30.000	280.000	60.000	190.000	260.000	9.036.725
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	10.000	307.752
Sonstige Forderungen**	77.780	940.484	69.324	765.005	666.165	4.825.062
SUMME VERMÖGENSWERTE	77.088.149	375.655.871	197.907.398	646.710.268	360.971.740	5.794.763.855
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	1.233.675	7.646.041	1.106.350	240.837.000	15.912.241	322.932.410
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	11.864	677.040	2.083.612	8.363.527	24.531.138	50.604.318
Fällige Managementgebühren	24.918	356.643	239.328	437.334	336.160	4.121.896
Fällige Performancegebühren	-	3.741.533	4.047.509	9.569.066	-	29.620.244
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	481.946	129.516	2.165.537	1.498.644	4.440.297
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	9	-	-	-	-	8
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	1.290.000	-	-	1.195.718
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	270.000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	30.000	280.000	60.000	190.000	270.000	9.074.478
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen***	29.699	148.921	111.462	512.486	183.560	14.943.950
SUMME VERBINDLICHKEITEN	1.330.165	13.332.124	9.067.777	262.074.950	42.731.743	437.203.319
SUMME NETTOVERMÖGEN	75.757.984	362.323.747	188.839.621	384.635.318	318.239.997	5.357.560.536

* Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit dem folgenden Wechselkurs vom 28. März 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,07885 US-Dollar.

** Die sonstigen Forderungen umfassen Forderungen aus Devisenkassageschäften und verschiedene andere Forderungen.

*** Die sonstigen Verbindlichkeiten und Rückstellungen beinhalten Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften sowie Verbindlichkeiten aus Verwaltungs-, Depot- und sonstigen Gebühren.

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ERTRÄGE						
Nettodividenden ^	166.347	74.534	-	-	1.286.984	6.020.901
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	701.656	137.792.979	-	-	348.695
Nettoertrag aus Swaps	187.861	2.568.683	-	3.241.016	465.676	2.156.441
Bankzinsen	20.434	2.124.479	6.319.484	737.060	1.236.534	940.946
Sonstige Erträge	-	83	-	-	98	134
SUMME ERTRÄGE	374.642	5.469.435	144.112.463	3.978.076	2.989.292	9.467.117
AUFWAND						
Performancegebühren	28.014	32.578	801.483	3.230.004	9.737.787	-
Managementgebühren	15.956	1.864.762	11.664.761	1.171.891	3.082.851	1.074.412
Nettodividendenaufwand^	-	-	-	747.560	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	-	-	-
Verwahrstellengebühren	3.324	124.884	373.241	24.988	60.151	49.359
Verwaltungsgebühren	7.681	558.756	2.096.645	281.056	657.543	183.361
Taxe d'abonnement	1.086	86.026	209.796	45.369	106.394	51.837
Vertriebsgebühren	-	-	-	2.454	49.062	-
Bank- und Zinskosten	975	2.293	4.028	53	604	2.909
Sonstige Aufwendungen	1.982	158.321	463.214	46.362	662.257	85.733
SUMME AUFWAND	59.018	2.827.620	15.613.168	5.549.737	14.356.649	1.447.611
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	112.448	18.829	-	-	11.544
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	315.624	2.754.263	128.518.124	(1.571.661)	(11.367.357)	8.031.050

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
ERTRÄGE						
Nettodividenden ^	24.610	28.375	239.023	128.984	-	7.481.334
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	2.578.238	-	50.112	5.808.110	608.309	137.079.392
Nettoertrag aus Swaps	-	98.147	485.088	-	187.096	8.737.755
Bankzinsen	107.138	951.231	475.564	3.629.944	1.122.761	16.464.825
Sonstige Erträge	40.192	-	29	-	272	37.832
SUMME ERTRÄGE	2.750.178	1.077.753	1.249.816	9.567.038	1.918.438	169.801.138
AUFWAND						
Performancegebühren	-	3.741.533	4.047.509	9.569.066	-	29.620.243
Managementgebühren	171.401	2.141.516	1.459.445	2.807.760	2.458.551	26.098.521
Nettodividendenaufwand^	-	-	-	-	54.602	743.534
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	9.775.908	-	9.061.416
Verwahrstellengebühren	17.823	42.623	28.567	52.972	71.556	791.798
Verwaltungsgebühren	57.832	243.342	280.824	589.063	617.830	5.214.608
Taxe d'abonnement	14.096	53.713	45.070	89.686	84.565	737.848
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	-	51.337
Bank- und Zinskosten	60.486	-	-	-	23.635	88.085
Sonstige Aufwendungen	14.607	76.242	38.414	93.386	278.659	1.827.312
SUMME AUFWAND	336.245	6.298.969	5.899.829	22.977.841	3.589.398	74.234.702
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	20.699	-	-	-	151.569
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	2.413.933	(5.200.517)	(4.650.013)	(13.410.803)	(1.670.960)	95.718.005

* 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 28. März 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,07885 US-Dollar.

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)*	315.624	2.754.263	128.518.124	(1.571.661)	(11.367.357)	8.031.050
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	155.637	(5.134.475)	4.110.299	21.187.309	26.277.177	6.143.411
aus Devisenterminkontrakten	13.297	73.181	51.993.782	2.699.177	(1.611.423)	5.268.032
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	12.609.163	-	-	-	(12.398.982)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	(6.073.349)	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	5.845.387	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	(119.426)	(43.515.242)
aus Differenzkontrakten	(501.754)	-	-	(15.215.768)	-	15.177.064
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	1.546.589	-	1.092.507	-	(1.092.849)
aus Devisengeschäften	(36.570)	(321.964)	(727.023)	22.759	113.751	(1.854.141)
REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST)	(369.390)	8.544.532	55.377.058	9.785.984	24.660.079	(32.272.707)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	1.870.622	16.134.679	42.914.670	20.285.674	50.156.303	34.033.050
aus Devisenterminkontrakten	(70.945)	2.918.808	(44.356.662)	(855.574)	2.463.995	(2.194.551)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(3.978.318)	-	-	-	(3.099.739)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	10.365.186	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	(11.374.410)	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	5.316.260	(15.302.099)
aus Differenzkontrakten	(639.057)	1.455.525	-	(5.436.609)	-	15.783.178
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	(11.430)	-	(388.898)	-	(405.960)
aus Devisengeschäften	(1.724)	532.963	(38.694)	4.058	6.131	1.491.475
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	1.158.896	16.043.003	(1.480.686)	13.608.651	57.942.689	30.305.354
NETTOVERÄNDERUNG DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	1.105.130	27.341.798	182.414.496	21.822.974	71.235.411	6.063.697
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	10.111.100	29.601.253	690.115.538	48.193.751	70.440.818	46.958.616
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(7.419)	(109.248.384)	(237.322.510)	(36.873.669)	(92.313.669)	(67.518.911)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	-	(777.252)	-	-	-
ZUWACHS/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS	11.208.811	(52.305.333)	634.430.272	33.143.056	49.362.560	(14.496.598)
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	10.603.804	400.977.339	2.479.858.286	153.926.693	410.569.595	296.663.280
Nennwährungsanpassung**	-	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	21.812.615	348.672.006	3.114.288.558	187.069.749	459.932.155	282.166.682

* 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 2023 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 28. März 2024.

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	2.413.933	(5.200.517)	(4.650.013)	(13.410.803)	(1.670.960)	95.718.005
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	211.344	9.991.445	12.422.255	(173)	21.991.095	92.160.430
aus Devisenterminkontrakten	940.520	3.598.528	50.153	4.982.815	5.910.562	68.398.353
aus Kassageschäften	-	-	-	(28.146)	-	(26.089)
aus Terminkontrakten	(95.939)	-	-	8.178.047	(711.882)	7.026.377
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.324.034)	(1.227.264)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	900.133	(511.958)	(5.269.661)
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	(44.096)	(40.873)
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	4.301	3.986
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.576.327)	3.957.047
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(2.183.277)	46.497.370	(8.433.797)	(7.196.356)
aus Differenzkontrakten	-	8.728.464	-	-	-	7.589.569
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	3.460.023	-	-	(889.589)	3.815.805
aus Devisengeschäften	86.345	(2.649)	6.680	20.377	(2.115.257)	(4.447.998)
REALISierter NETTOGEWINN	1.142.270	25.775.811	10.295.811	60.550.423	12.299.018	164.743.326
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	3.520.865	55.365.995	18.735.023	9.757	5.532.372	234.058.339
aus Devisenterminkontrakten	(1.032.261)	(995.000)	(259.844)	(1.468.490)	(2.476.756)	(44.615.095)
aus Kassageschäften	-	-	-	(24.209)	-	(22.439)
aus Terminkontrakten	(8.252)	-	-	(2.916.078)	(477.130)	(9.713.602)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	833.813	772.873
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	127.500	176.628	9.889.527
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.864)	(1.728)
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(413.476)	(383.255)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	255.639	(10.306.132)
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(2.774.768)	125.912	(2.693.084)	(13.818.966)
aus Differenzkontrakten	-	8.941.326	-	-	-	18.634.994
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	1.412.554	-	-	(552.068)	50.238
aus Devisengeschäften	(10.534)	(465)	420	47.302	2.313.989	4.027.812
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	2.469.818	64.724.410	15.700.831	(4.098.306)	2.498.063	188.572.566
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	6.026.021	85.299.704	21.346.629	43.041.314	13.126.121	449.033.897
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	6.213.041	52.577.425	8.535.205	50.797.990	38.324.809	980.139.800
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(6.036.902)	(106.679.349)	(12.479.229)	(88.123.114)	(216.817.092)	(909.022.754)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	(37.218)	-	-	-	-	(754.943)
ZUWACHS/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS	6.164.942	31.197.780	17.402.605	5.716.190	(165.366.162)	519.396.000
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	69.593.042	331.125.967	171.437.016	378.919.128	483.606.159	4.928.621.911
Nennwährungsanpassung ***	-	-	-	-	-	(90.457.375)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	75.757.984	362.323.747	188.839.621	384.635.318	318.239.997	5.357.560.536

* 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 28. März 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,07885 US-Dollar.

** 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 2023 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 28. März 2024.

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	41,04	70,45	89,48	-	-	9,11
Sonstige Wertpapiere						
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	2,83	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	-	0,10
Bekleidung	1,57	-	-	-	-	1,26
Automobilhersteller	-	-	-	-	-	1,14
Autoteile und -zubehör	1,91	-	-	-	-	2,28
Banken	4,10	-	-	-	4,86	9,55
Getränke	1,18	-	-	-	-	1,43
Biotechnologie	-	-	-	-	-	0,10
Baustoffe	-	-	-	-	2,50	0,09
Chemie	-	-	-	-	-	1,02
Kohle	-	-	-	-	-	-
Gewerbliche Dienstleistungen	3,90	-	-	4,08	2,22	2,28
Computer	1,55	-	-	2,62	-	1,35
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	-	0,90
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	-	8,47	2,52
Elektrik	-	-	-	-	-	0,09
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	-	1,55
Elektronik	3,79	-	-	9,36	-	3,63
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	-	0,23
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-	0,03
Unterhaltung	-	-	-	1,62	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	-	0,03
Lebensmittel	-	-	-	-	-	1,08
Gas	-	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	5,37	0,05
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	1,11	-	-	-	-	0,65
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	-	0,85
Haushaltswaren	1,17	-	-	-	-	0,79
Versicherung	1,38	-	2,38	-	11,41	1,23
Internet	0,45	-	-	15,48	15,29	0,76
Investmentgesellschaften	-	-	-	-	-	7,93
Freizeit	1,89	-	-	-	-	0,66
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	1,89	0,40
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	-	0,43
Maschinen – Diversifiziert	2,53	-	-	-	-	0,70
Medien	-	-	-	8,68	-	-
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	-	-
Bergbau	-	-	-	-	-	0,53
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	5,64	0,06
Öl und Gas	-	-	-	-	1,93	0,72
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	2,01	1,55
Pipelines	-	-	-	-	-	-

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)						
Immobilien	-	-	-	-	-	1,24
Einzelhandel	0,76	-	-	1,65	-	2,50
Bausparkassen	-	-	-	-	-	-
Halbleiter	25,19	-	-	18,02	-	23,68
Software	-	-	-	30,31	11,20	1,17
Telekommunikation	-	-	-	-	-	1,05
Transport	-	-	-	-	10,66	0,72
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	93,52	70,45	91,86	91,82	86,28	87,44
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	6,48	29,55	8,14	8,18	13,72	12,56
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	97,08	1,36	18,41	0,03	49,93
Sonstige Wertpapiere					
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	3,17	-	0,18
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	1,42	-	-
Bekleidung	-	-	0,10	-	0,35
Automobilhersteller	-	-	2,00	-	0,12
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,02
Banken	-	-	1,01	-	6,94
Getränke	-	-	1,18	-	0,12
Biotechnologie	-	-	-	-	2,25
Baustoffe	-	5,76	-	-	0,14
Chemie	-	-	0,16	-	-
Kohle	-	-	-	-	0,02
Gewerbliche Dienstleistungen	-	3,27	3,05	-	0,51
Computer	-	-	0,64	-	0,01
Kosmetik und Körperpflege	-	-	0,15	-	0,32
Vertrieb und Großhandel	-	4,70	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	0,29	-	2,63
Elektrik	-	-	-	-	0,83
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,19
Elektronik	-	4,43	-	-	0,19
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,21
Bau- und Ingenieurwesen	-	4,52	-	-	-
Unterhaltung	-	9,50	-	-	0,46
Umweltschutz	-	2,13	2,08	-	-
Lebensmittel	-	-	0,18	-	-
Gas	-	-	-	-	0,29
Gesundheitswesen – Produkte	-	2,30	14,08	-	1,02
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	0,89	-	1,03
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	0,10
Heimeinrichtungsgegenstände	-	6,71	-	-	0,12
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherung	-	5,10	-	-	1,27
Internet	-	5,76	6,13	-	1,16
Investmentgesellschaften	-	-	2,95	1,30	1,18
Freizeit	-	-	1,54	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	0,19	-	0,06
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,06
Maschinen – Diversifiziert	-	11,83	1,37	-	0,01
Medien	-	-	-	-	0,19
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,11
Bergbau	-	-	-	-	0,39
Diverse Fertigungsbetriebe	-	4,95	3,67	-	-
Öl und Gas	-	-	-	-	7,26
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	0,21
Pharmazeutika	-	-	3,62	-	1,88
Pipelines	-	-	-	-	0,78

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Immobilien	-	-	-	-	0,22
Einzelhandel	-	4,51	0,26	-	0,42
Bausparkassen	-	-	0,24	-	-
Halbleiter	-	3,18	8,03	-	0,64
Software	-	6,67	10,50	-	0,74
Telekommunikation	-	-	1,03	-	0,17
Transport	-	-	3,46	-	0,06
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	97,08	86,68	91,80	1,33	84,79
Termineinlagen	-	-	-	62,61	-
Sonstiges Nettovermögen	2,92	13,32	8,20	36,06	15,21
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Anlageportfolio zum 31. März 2024

Schroder GAIA Asian Equity Long Short

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Aktien				
China				
13.640	CNH	Contemporary Ampere Technology	354.565	1,63
26.400	CNH	Jiangsu Hengli Hydraulic	183.106	0,84
1.100	CNH	Kweichow Moutai	257.743	1,18
137.756	CNH	Yizumi Holdings	368.371	1,69
Indonesien			687.723	3,15
950.600	IDR	Bank Mandiri Persero	434.680	1,99
680.000	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	253.043	1,16
Philippinen			1.002.408	4,60
75.500	PHP	BDO Unibank	207.502	0,95
111.100	PHP	International Container Terminal Services	628.476	2,89
526.200	PHP	Wilcon Depot	166.430	0,76
Südkorea			2.108.269	9,67
701	KRW	NAVER	97.424	0,45
27.474	KRW	Samsung Electronics	1.648.950	7,56
1.314	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	301.598	1,38
170	KRW	Samsung SDI	60.297	0,28
Taiwan			6.241.396	28,61
26.598	TWD	Advantech	338.256	1,55
133.000	TWD	ASE Technology Holding	644.148	2,95
59.000	TWD	Chroma ATE	465.496	2,13
20.000	TWD	Eclat Textile	341.838	1,57
24.000	TWD	MediaTek	869.905	3,99
62.000	TWD	Merida Industry	411.674	1,89
23.000	TWD	Nien Made Enterprise	255.128	1,17
27.750	TWD	Sporton International	223.276	1,02
97.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	2.330.777	10,69
7.000	TWD	Voltronic Power Technology	360.898	1,65
Thailand			242.259	1,11
312.900	THB	Bangkok Dusit Medical Services	242.259	1,11
Summe Aktien			11.445.840	52,48
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			11.445.840	52,48

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA				
900.000	USD	United States Treasury Bill 04/04/24, ZCP	899.217	4,12
900.000	USD	United States Treasury Bill 11/04/24, ZCP	898.305	4,12
800.000	USD	United States Treasury Bill 18/04/24, ZCP	797.691	3,66
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	996.039	4,57
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 02/05/24, ZCP	995.054	4,56
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 09/05/24, ZCP	994.015	4,56
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	993.007	4,55
900.000	USD	United States Treasury Bill 23/05/24, ZCP	892.802	4,09
1.500.000	USD	United States Treasury Bill 30/05/24, ZCP	1.486.430	6,81
Summe Anleihen			8.952.560	41,04
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			8.952.560	41,04
Summe Kapitalanlagen			20.398.400	93,52
Sonstiges Nettovermögen			1.414.215	6,48
Nettoinventarwert			21.812.615	100,00

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA				
31.500.000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0,38 %	31.440.052	9,02
22.000.000	USD	United States Treasury Note 15/01/22, 2,50 %	21.949.255	6,30
44.500.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0,25 %	44.228.059	12,68
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 2,50 %	8.968.830	2,57
16.000.000	USD	United States Treasury Note 15/01/22, 2,50 %	15.926.538	4,57
28.500.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0,25 %	28.201.370	8,09
16.000.000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0,38 %	15.773.818	4,52
14.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/22, 1,75 %	14.329.746	4,11
6.000.000	USD	United States Treasury Note 31/07/24, 3,00 %	5.953.340	1,71
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/03/22, 2,38 %	9.890.318	2,84
5.000.000	USD	United States Treasury Note 31/08/24, 1,25 %	4.917.336	1,41
16.000.000	USD	United States Treasury Note 31/08/24, 3,25 %	15.865.321	4,55
2.000.000	USD	United States Treasury Note 15/08/21, 2,13 %	1.969.638	0,56
Summe Anleihen			219.413.621	62,93
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			219.413.621	62,93

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Irland				
672.425.725	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	26.224.603	7,52
Summe Anleihen			26.224.603	7,52
Summe sonstige Wertpapiere			26.224.603	7,52
Summe Kapitalanlagen			245.638.224	70,45
Sonstiges Nettovermögen			103.033.782	29,55
Nettoinventarwert			348.672.006	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Nettover- mögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Nettover- mögens		
Aktien											
Bermuda											
697	USD	Voussoir Re	7.667	-	4.100.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	4.139.873	0,13		
Supranational											
550	USD	Voussoir Re SideCar	123.200	-	11.188.861	USD	Kilimanjaro III Re 19/12/26, variabel	10.909.140	0,35		
697	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	48.790	-	593.390	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel	118.678	-		
530	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	-	-	25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel	25.619.280	0,83		
557	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	63.841.669	2,05	11.500.000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	11.612.125	0,37		
667	USD	Voussoir Re-Preference	10.226.444	0,33	13.500.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	13.530.038	0,43		
Summe Aktien			74.247.770	2,38	9.917.000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	9.712.958	0,31		
Anleihen					18.947.000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	18.722.004	0,61		
Bermuda					279.663.078	8,98	11.750.000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel	12.219.119	0,39
19.450.000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	19.378.035	0,63	8.250.000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	8.411.081	0,27		
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	10.215.790	0,33	8.750.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	8.075.375	0,26		
2.667.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2.646.797	0,08	6.256.000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	6.219.090	0,20		
3.500.000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel	3.556.875	0,11	14.958.000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	14.768.407	0,47		
500.000	USD	Bowline Re 23/05/25, variabel	507.775	0,02	9.902.000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	9.889.870	0,32		
2.500.000	USD	Citrus Re Series A 07/06/27, variabel	2.500.000	0,08	250.000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	252.894	0,01		
4.500.000	USD	Citrus Re Series B 07/06/27, variabel	4.500.000	0,14	Irland						
89.359	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	50.693	-	8.750.000	EUR	King Max Re Designated Activity 06/01/27, variable	9.535.753	0,31		
24.512.000	USD	Everglades Re II 14/05/24, variabel	24.684.196	0,80	23.000.000	USD	Queen Street 2023 Re DAC 08/12/25, variabel	24.055.125	0,77		
9.417.000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	9.135.432	0,29	Singapur						
2.600.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	2.597.270	0,08	7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/28, variabel	174.375	0,01		
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/28, variabel	3.312.500	0,11	6.250.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6.222.969	0,20		
13.053.671	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	12.727.330	0,41	54.825.000	USD	Nakama Re Series 1 13/10/26, variabel	54.204.106	1,73		
12.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	12.006.017	0,39	1.125.000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/38, ZCP	1.716.500	0,06		
4.380.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	4.378.248	0,14	3.000.000	USD	Phoenix 2 Re Series 24B 04/01/38, ZCP	3.399.250	0,11		
4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4.780.638	0,15	4.012.000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4.633.377	0,15		
8.500.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	8.485.550	0,27	10.000.000	NZD	Totara Re 08/06/27, 13,39 %	5.959.563	0,19		
Summe Anleihen			279.663.078	8,98	Supranational			13.421.869	0,43		

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 15/04/24, variabel	2.351.250	0,08
10.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variabel	11.070.619	0,35
Summe Anleihen			402.985.965	12,94
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			477.233.735	15,32

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Bermuda			1.513.738.561	48,62
17.679.000	USD	2001 Cat Re 08/01/27, variabel	18.641.622	0,60
36.059.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	36.296.087	1,16
4.000.000	USD	Alamo Re 07/06/26, variable	4.123.800	0,13
6.076.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1B 08/06/26, variabel	6.228.204	0,20
7.971.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1C 08/06/26, variabel	8.258.952	0,27
7.200.000	USD	Aragonite Re 07/04/27, variabel	7.236.000	0,23
2.450.000	USD	Artex Axcell Re Bermuda 17/01/25, variable	-	-
5.707.000	USD	Ashera Re 07/04/27, variabel	5.735.535	0,18
2.761.000	USD	Baldwin Re 07/07/27, variabel	2.804.693	0,09
4.600.000	USD	Bayou Re Series A 26/05/26, variabel	4.801.710	0,15
2.000.000	USD	Bayou Re Series B 26/05/26, variabel	2.108.050	0,07
2.250.000	USD	Blue Ridge Re 08/01/27, variabel	2.258.606	0,07
3.500.000	EUR	Blue Sky Re DAC 26/01/27, variable	3.891.614	0,12
19.996.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	19.676.064	0,63
12.250.000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	11.641.481	0,37
6.750.000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variabel	6.867.956	0,22
3.333.000	USD	Bowline Re 23/05/25, variabel	3.390.161	0,11

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
10.000.000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	9.917.250	0,32
8.405.000	USD	Cape Lookout Re 28/04/26, variabel	8.641.601	0,28
24.419.000	USD	Cape Lookout Re 05/04/27, variabel	24.541.094	0,79
6.750.000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel	6.815.644	0,22
7.500.000	USD	Citrus Re Series A 07/06/26, variabel	7.752.563	0,25
5.000.000	USD	Citrus Re Series B 07/06/26, variabel	5.192.125	0,17
10.833.000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	10.978.704	0,35
20.000.000	USD	Easton Re 08/01/27, variabel	20.941.000	0,67
330.599	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	94.882	-
717.699	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	246.171	0,01
1.166.016	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	648.538	0,02
25.714	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP	127.338	-
100.000	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP	3.285.395	0,11
11.300.000	USD	Eden Re II 17/03/28, ZCP	11.610.750	0,37
28.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel	28.944.780	0,92
22.750.000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel	22.903.562	0,74
7.750.000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variabel	7.642.469	0,25
1.250.000	USD	Finca Re 06/06/25, variabel	1.302.563	0,04
7.973.000	USD	First Coast Re IV 07/04/26, variabel	8.177.308	0,26
26.520.000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	26.067.833	0,84
8.750.000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	8.533.000	0,27
2.250.000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	2.156.063	0,07
17.708.000	USD	FloodSmart Re Series A 11/03/26, variabel	17.969.636	0,58
4.500.000	USD	FloodSmart Re Series B 11/03/26, variabel	4.609.575	0,15
35.712.000	USD	FloodSmart Re Series A 12/03/27, variabel	35.698.607	1,14
8.500.000	USD	FloodSmart Re Series B 12/03/27, variabel	8.496.813	0,27
16.750.000	USD	Foundation Re IV 08/01/27, variabel	16.639.450	0,53
7.917.000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variabel	8.105.623	0,26

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens
4.000.000	USD	Four Lakes Re 07/01/27, variabel	4.074.500	0,13	5.000.000	USD	Lower Ferry Re Series A 08/07/26, variabel	5.112.750	0,16
3.806.744	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	2.093.709	0,07	9.750.000	USD	Lower Ferry Re Series B 08/07/26, variabel	9.954.994	0,32
10.000.000	USD	Fuchsia 2023-1 - London Bridge 2 PCC 06/04/27, variable	10.114.500	0,32	4.257.000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variabel	4.323.090	0,14
2.750.000	USD	Galileo Re 08/01/26, variabel	2.829.406	0,09	7.750.000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	7.744.188	0,25
8.261.000	USD	Galileo Re 07/01/28, variabel	8.619.734	0,28	11.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	11.516.388	0,37
7.680.000	USD	Gateway Re II 27/04/26, variabel	7.994.304	0,26	14.750.000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	14.462.006	0,46
5.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	5.055.250	0,16	7.500.000	USD	Matterhorn Re 08/01/27, variabel	4.200.000	0,13
833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	825.045	0,03	7.600.000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7.589.360	0,24
1.866.569	USD	Herbie Re 08/01/26, variabel	1.423.259	0,05	5.250.000	USD	Mayflower Re Series A 08/07/26, variabel	5.340.169	0,17
6.000.000	USD	Herbie Re 08/01/27, variabel	6.313.950	0,20	5.750.000	USD	Mayflower Re Series B 08/07/26, variabel	5.891.594	0,19
9.000.000	USD	Herbie Re Series A 07/01/28, variabel	8.988.975	0,29	20.144.000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	20.122.849	0,65
3.000.000	USD	Herbie Re Series B 07/01/28, variabel	2.992.950	0,10	15.000.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	15.140.625	0,49
9.250.000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	9.139.000	0,29	14.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	14.203.000	0,46
750.000	USD	Hestia Re 07/04/26, variabel	761.719	0,02	21.250.000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	21.721.218	0,70
2.250.000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/26, variabel	2.577.305	0,08	10.091.000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/26, variabel	10.594.793	0,34
2.812.000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/28, variabel	3.109.569	0,10	11.091.000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/26, variabel	11.897.316	0,38
9.000.000	USD	High Point Re 06/01/27, variabel	9.099.000	0,29	23.750.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	24.006.499	0,77
9.258.000	USD	Hypatia 08/04/26, variabel	9.828.061	0,32	8.250.000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variabel	8.949.394	0,29
6.750.000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	5.138.438	0,16	6.671.000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variabel	7.244.039	0,23
10.941.000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variabel	11.386.846	0,37	8.462.000	USD	Montoya Re 07/04/26, variabel	9.240.081	0,30
3.215.000	USD	Integrity Re Series B 06/06/26, variabel	3.213.714	0,10	5.667.000	USD	Montoya Re 07/04/27, variabel	5.898.922	0,19
1.500.000	USD	Integrity Re Series D 06/06/26, variabel	1.499.400	0,05	10.500.000	USD	Mountain Re 05/06/26, variabel	10.769.325	0,35
5.100.000	USD	Kendall Re 02/05/24, variabel	5.104.080	0,16	14.250.000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variabel	14.880.563	0,48
7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	7.836.572	0,25	20.115.000	USD	Mystic Re IV 08/01/27, variabel	20.556.524	0,66
23.344.000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	23.868.655	0,77	13.250.000	USD	Mystic Re IV Series A 08/01/25, variabel	13.110.544	0,42
10.464.000	USD	Kilimanjaro III Re 20/04/26, variabel	10.331.107	0,33	6.500.000	USD	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variabel	6.434.188	0,21
5.906.000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variabel	6.028.992	0,19					

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens
6.602.000	USD	Nakama Re Series 1 09/05/28, variabel	6.552.485	0,21	17.107.000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	16.852.106	0,54
8.111.000	USD	Nakama Re Series 2 09/05/28, variabel	8.291.875	0,27	2.708.000	USD	Titania Re 27/02/26, variabel	2.946.033	0,09
3.750.000	USD	Nature Coast Re 07/12/26, variabel	3.843.844	0,12	9.250.000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel	9.104.081	0,29
11.668.000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	12.185.476	0,39	9.475.000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel	9.308.714	0,30
10.000.000	USD	Ocelot Re 07/01/27, variabel	10.304.250	0,33	8.250.000	USD	Tomoni Re Series A 05/04/28, variabel	8.291.250	0,27
13.000.000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	12.930.125	0,42	6.171.000	USD	Tomoni Re Series B 05/04/28, variabel	6.201.855	0,20
2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2.251.294	0,07	19.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	19.035.625	0,61
3.286.000	USD	Purple Re 24/04/26, variabel	3.393.945	0,11	19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	19.228.344	0,62
5.653.000	USD	Purple Re 05/06/26, variabel	5.795.032	0,19	9.500.000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	9.502.375	0,31
8.250.000	USD	Ramble Re 05/03/27, variabel	8.254.125	0,27	5.000.000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	4.968.875	0,16
10.000.000	EUR	Randolph Re 15/06/24, ZCP	8.630.800	0,28	8.333.000	USD	Torrey Pines Re Series A 05/06/26, variabel	8.472.786	0,27
23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	22.589.449	0,73	4.875.000	USD	Torrey Pines Re Series B 05/06/26, variabel	4.957.144	0,16
5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5.556.369	0,18	21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	20.875.650	0,67
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	19.686.694	0,63	10.500.000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	10.539.638	0,34
18.792.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	18.695.221	0,60	5.250.000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	5.209.444	0,17
11.500.000	USD	Sakura Re 05/01/26, variabel	12.500.500	0,40	17.500.000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variabel	18.231.500	0,59
10.875.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel	10.854.338	0,35	11.250.000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variabel	11.821.219	0,38
1.468.485	USD	Sanders Re II 07/04/26, variabel	13.951	-	8.173.000	USD	Ursa Re Series AA 06/12/25, variabel	8.325.631	0,27
12.050.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	11.656.266	0,37	2.419.000	USD	Ursa Re Series C 06/12/25, variabel	2.469.618	0,08
17.750.000	USD	Sanders Re III 05/06/26, variabel	18.272.294	0,59	15.000.000	USD	Ursa Re Series AA 07/12/26, variabel	15.415.875	0,50
5.156.000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variabel	5.199.310	0,17	14.750.000	USD	Ursa Re Series D 07/12/26, variabel	15.012.550	0,48
10.000.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variabel	10.171.250	0,33	3.750.000	USD	Ursa Re Series E 07/12/26, variabel	3.797.156	0,12
29.300.000	USD	Sanders Re III 07/04/28, variabel	29.702.874	0,94	6.000.000	USD	Veraison Re 09/03/26, variabel	6.302.400	0,20
6.079.000	USD	Solomon Re 08/06/26, variabel	6.323.072	0,20	13.715.000	USD	Veraison Re 08/03/27, variabel	13.890.552	0,45
3.375.000	USD	Stabilitas Re 05/06/26, variabel	3.530.081	0,11	18.006.000	USD	Winston Re Series A 26/02/27, variabel	17.930.825	0,58
20.975.000	USD	Sutter Re Series B 19/06/26, variabel	21.409.707	0,69	8.000.000	USD	Winston Re Series B 26/02/27, variabel	7.961.400	0,26
11.781.000	USD	Sutter Re Series E 19/06/26, variabel	12.007.490	0,39	9.625.000	USD	Wrigley Re Series A 07/08/26, variabel	9.884.634	0,32
14.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	14.507.613	0,47	8.565.000	USD	Wrigley Re Series B 07/08/26, variabel	8.938.220	0,29

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens
Kaimaninseln									
			188.509.191	6,05	4.000.000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	3.970.500	0,13
1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	1.082.941	0,03	14.000.000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variabel	14.258.300	0,46
3.747.995	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	1.293.058	0,04	5.550.000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variabel	5.727.184	0,18
11.550.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	11.558.374	0,37	11.022.000	USD	Vitality Re XV Series A 07/01/28, variabel	11.023.929	0,35
18.500.000	USD	Fish Pond Re 08/01/27, variable	18.621.175	0,59	4.320.000	USD	Vitality Re XV Series B 07/01/28, variabel	4.361.040	0,14
800.000	USD	Long Point Re IV 01/06/26, variabel	806.520	0,03	Hongkong				
1.480.545	USD	Residential Reinsurance 2019 06/06/26, variabel	1.312.910	0,04	11.558.000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	11.764.310	0,37
6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6.145.077	0,20	3.250.000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variabel	3.298.750	0,11
7.984.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	7.748.871	0,25	Irland				
5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	4.892.625	0,16	19.425.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	19.573.601	0,63
4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3.792.063	0,12	16.500.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	17.280.450	0,55
8.285.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	7.693.037	0,25	8.000.000	EUR	Azzurro Re II DAC 20/04/28, variabel	8.673.954	0,28
4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4.441.001	0,14	19.500.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	20.739.893	0,67
6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6.247.475	0,20	5.250.000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	5.685.061	0,18
17.416.667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	16.534.948	0,53	2.042.000	EUR	Orange Capital Re DAC 08/01/27, variabel	2.253.956	0,07
4.310.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	4.081.462	0,13	4.000.000	EUR	Taranis Reinsurance DAC 21/01/28, variabel	4.466.439	0,14
6.300.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	5.982.480	0,19	9.769.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	10.548.244	0,34
2.950.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2.799.845	0,09	Singapur				
3.750.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variabel	3.899.156	0,13	4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	3.400.000	0,11
8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variabel	8.627.925	0,28	12.000.000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	12.465.000	0,40
12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	12.062.066	0,39	5.250.000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5.469.056	0,18
6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5.985.600	0,19	14.866.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	14.416.675	0,46
13.648.000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	13.559.629	0,44	8.957.000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	9.325.045	0,30
					5.000.000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	4.989.681	0,16
					6.786.000	USD	Kizuna Re III 09/04/29, variabel	6.793.804	0,22
					17.714.000	USD	Nakama Re Series 2 13/10/26, variabel	17.704.701	0,56
					5.000.000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	4.959.750	0,16

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
2.750.000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2.733.981	0,09
2.500.000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	2.490.375	0,08
Vereinigtes Königreich			30.043.038	0,96
29.750.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	30.043.038	0,96
USA			449.280.937	14,44
6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	6.310.422	0,20
12.000.000	USD	Gateway Re 23/12/24, variabel	11.010.000	0,35
11.875.000	USD	Gateway Re 23/12/24, ZCP	11.043.750	0,35
13.700.000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	14.113.398	0,45
20.666.000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variabel	22.410.727	0,72
4.500.000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variabel	4.565.813	0,15
10.000.000	USD	Gateway Re 08/07/27, variabel	10.005.500	0,32
478.904	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7,14 %	492.332	0,02
15.000.000	USD	Lightning Re 31/03/26, variabel	16.153.875	0,52
5.250.000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	5.197.631	0,17
1.050.000	USD	Residential Reinsurance 2023 06/12/24, variabel	934.605	0,03
8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 13 06/06/27, variabel	8.327.238	0,27
17.300.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 14 06/06/27, variabel	17.101.483	0,55
2.031.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 3 06/12/27, variabel	2.025.821	0,07
2.265.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 5 06/12/27, variabel	2.275.476	0,07
900.000	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	900.000	0,03
200.000.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	199.299.749	6,40
100.000.000	USD	United States Treasury Bill 23/05/24, ZCP	99.243.399	3,19
13.903.000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	13.956.874	0,45
3.750.000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	3.912.844	0,13
Summe Anleihen			2.370.604.453	76,13
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			2.370.604.453	76,13

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Bermuda			83.481	-
4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	83.481	-
USA			12.761.907	0,41
12.665.622	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96 %	11.652.373	0,37
2.400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
1.404.474	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1.109.534	0,04
Summe Anleihen			12.845.388	0,41
Summe sonstige Wertpapiere			12.845.388	0,41
Summe Kapitalanlagen			2.860.683.576	91,86
Sonstiges Nettovermögen			253.604.982	8,14
Nettoinventarwert			3.114.288.558	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens
Aktien				
Israel				
152.815	USD	Global-e Online	5.554.825	2,97
Taiwan				
26.787	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing – ADR	3.644.371	1,95
USA				
90.332	USD	Block	7.640.281	4,08
5.393	USD	Broadcom	7.147.936	3,82
35.040	USD	Carvana	3.080.366	1,65
155.193	USD	Comcast	6.727.617	3,60
18.456	USD	CyberArk Software	4.902.467	2,62
104.078	USD	HashiCorp	2.804.902	1,50
39.544	USD	Liberty Media-Liberty Formula One	2.594.086	1,39
114.752	USD	Marvell Technology	8.133.622	4,35
30.900	USD	Microsoft	13.000.248	6,95
17.328	USD	MongoDB	6.214.514	3,32
264.000	USD	News	6.911.520	3,69
5.422	USD	NVIDIA	4.899.102	2,62
144.500	USD	Oracle	18.150.646	9,69
253.500	USD	Pinterest	8.788.845	4,70
58.892	USD	Qorvo	6.762.568	3,61
29.670	USD	Salesforce	8.936.011	4,78
113.486	USD	Semtech	3.119.730	1,67
26.300	USD	Spotify Technology	6.940.570	3,71
23.168	USD	Teradata	895.907	0,48
35.081	USD	TKO Group Holdings	3.031.349	1,62
272.000	USD	Trimble	17.505.920	9,36
43.000	USD	Unity Software	1.148.100	0,61
41.000	USD	Wayfair	2.783.080	1,49
214.300	USD	Zillow Group	10.453.554	5,59
Summe Aktien			171.772.137	91,82
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			171.772.137	91,82
Summe Kapitalanlagen			171.772.137	91,82
Sonstiges Nettovermögen			15.297.612	8,18
Nettoinventarwert			187.069.749	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- ver- mögen
Aktien				
Bermuda				
63.205	USD	RenaissanceRe Holdings	13.769.357	2,99
Kanada				
179.375	CAD	Canadian National Railway	21.894.126	4,76
332.292	CAD	Canadian Pacific Kansas City	27.156.713	5,90
477.853	CAD	Cenovus Energy	8.854.965	1,93
Dänemark				
78.115	DKK	Novo Nordisk	9.229.479	2,01
Frankreich				
62.040	EUR	Safran	13.031.502	2,83
Deutschland				
63.553	EUR	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft in München	28.745.021	6,25
90.062	EUR	SAP	16.252.589	3,53
37.931	EUR	Siemens	6.712.270	1,46
Indien				
204.322	USD	ICICI Bank	5.001.756	1,09
Vereinigtes Königreich				
386.800	HKD	HSBC Holdings	2.801.122	0,61
USA				
84.154	USD	Alphabet	11.876.802	2,58
162.553	USD	Amazon.com	27.178.301	5,91
142.503	USD	API Group	5.187.091	1,13
116.182	USD	Arch Capital Group	9.954.919	2,16
64.339	USD	Block	5.044.068	1,10
2.755	USD	Booking Holdings	9.264.318	2,01
144.085	USD	CRH	11.520.389	2,50
9.611	USD	First Citizens BancShares	14.565.496	3,17
120.405	USD	Fiserv	17.836.703	3,88
293.144	USD	GE HealthCare Technologies	24.701.971	5,37
118.024	USD	General Electric	19.202.626	4,18
43.930	USD	Hilton Worldwide Holdings	8.685.831	1,89
96.753	USD	Interactive Brokers Group	10.018.332	2,18
12.597	USD	Mastercard	5.622.966	1,22
48.928	USD	Meta Platforms	22.022.022	4,79
44.623	USD	Microsoft	17.401.667	3,78
90.072	USD	Visa	23.300.082	5,07
Summe Aktien			396.832.484	86,28
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			396.832.484	86,28
Summe Kapitalanlagen			396.832.484	86,28
Sonstiges Nettovermögen			63.099.671	13,72
Nettoinventarwert			459.932.155	100,00

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Aktien				
Bahrain				
429.244	BHD	Aluminium Bahrain BSC	1.400.451	0,50
Brasilien				
105.010	BRL	Arezzo Industria e Comercio	1.348.302	0,48
29.745	BRL	Azul	77.489	0,03
322.817	BRL	B3 – Brasil Bolsa Balcao	773.257	0,27
94.262	BRL	Banco Bradesco	268.537	0,10
9.539	BRL	Centrais Eletricas Brasileiras	79.467	0,03
13.330	BRL	Hypera	87.694	0,03
843.630	BRL	Itausa	1.769.660	0,62
107.514	BRL	Localiza Rent a Car	1.174.469	0,42
11.863	BRL	Orizon Valorizacao de Residuos	89.632	0,03
180.717	BRL	PRIO	1.759.676	0,61
255.484	BRL	Raia Drogasil	1.396.969	0,50
11.740	USD	XP	301.248	0,11
Chile				
1.328.447	CLP	Cia Sud Americana de Vapores	99.547	0,04
605.907	CLP	Colbun	78.212	0,03
3.471	CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile	168.445	0,05
China				
274.000	CNH	37 Interactive Entertainment Network Technology Group	665.715	0,24
4.509	CNH	Advanced Micro-Fabrication Equipment	92.696	0,03
2.038	USD	Alibaba Group Holding	147.470	0,05
30.600	CNH	Anjoy Foods Group	349.647	0,12
60.600	CNH	Asymchem Laboratories Tianjin	745.356	0,26
51.437	USD	Atour Lifestyle Holdings	922.780	0,33
26.200	CNH	Bafang Electric Suzhou	133.302	0,05
58.867	CNH	Beijing Huafeng Test & Control Technology	847.200	0,30
21.244	CNH	Beijing Kingsoft Office Software	874.848	0,31
38.100	CNH	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems	741.912	0,26
194.900	CNH	Chaozhou Three-Circle Group	667.348	0,24
67.300	CNH	China Jushi	97.051	0,03
67.000	HKD	China Mengniu Dairy	143.820	0,05

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
166.236	CNH	Contemporary Amperex Technology	4.322.357	1,54
29.044	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	158.333	0,06
38.800	HKD	Fuyao Glass Industry Group	195.327	0,07
5.500	USD	H World Group	212.850	0,08
41.600	CNH	Hangzhou Robam Appliances	137.227	0,05
10.700	CNH	Hithink RoyalFlush Information Network	198.691	0,07
78.316	CNH	Hongfa Technology	262.657	0,09
103.000	CNH	Hualan Biological Engineering	281.035	0,10
71.100	CNH	Jiangsu Hengli Hydraulic	493.266	0,17
14.100	CNH	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals	89.742	0,03
129.900	CNH	Jiangsu Yoke Technology	955.231	0,34
4.500	CNH	Kweichow Moutai	1.054.677	0,37
154.000	HKD	Lenovo Group	178.469	0,06
253.274	CNH	Midea Group	2.252.829	0,80
54.913	CNH	Pylon Technologies	657.634	0,23
603.500	CNH	Sany Heavy Industry	1.201.115	0,43
78.000	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	183.064	0,06
148.208	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1.229.487	0,44
122.400	HKD	Shenzhou International Group Holdings	1.158.870	0,41
82.650	CNH	Sichuan Injet Electric	585.007	0,21
32.100	CNH	StarPower Semiconductor	640.904	0,23
34.233	USD	Trip.com Group	1.502.486	0,53
114.300	CNH	Venustech Group	327.925	0,12
144.600	CNH	Wanhua Chemical Group	1.602.263	0,57
3.900	CNH	Wuliangye Yibin	82.239	0,03
30.000	CNH	WuXi AppTec	194.328	0,07
552.968	CNH	Yizumi Holdings	1.479.070	0,52
112.000	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	138.668	0,05
Kolumbien			203.186	0,07
38.688	COP	Banco Davivienda	203.186	0,07
Ägypten			200.860	0,07
126.010	USD	Commercial International Bank Egypt	200.860	0,07
Georgien			2.470.397	0,88
60.827	GBP	TBC Bank Group	2.470.397	0,88
Deutschland			1.113.229	0,39
11.170	EUR	Dr Ing hc F Porsche	1.113.229	0,39

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Griechenland			4.942.918	1,75
5.428	EUR	GEK TERNA	98.955	0,04
433.927	EUR	National Bank of Greece	3.400.460	1,20
344.834	EUR	Piraeus Financial Holdings	1.443.503	0,51
Hongkong			146.374	0,05
21.800	HKD	AIA Group	146.374	0,05
Ungarn			3.864.391	1,37
36.807	HUF	OTP Bank	1.694.818	0,60
85.483	HUF	Richter Gedeon	2.169.573	0,77
Indonesien			4.885.970	1,73
1.968.200	IDR	Bank Central Asia	1.250.685	0,44
4.557.600	IDR	Bank Mandiri Persero	2.084.049	0,74
3.394.100	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	1.263.021	0,45
1.316.900	IDR	Telkom Indonesia Persero	288.215	0,10
Italien			3.116.319	1,10
880	EUR	Ferrari	383.962	0,14
117.938	EUR	FinecoBank Banca Fineco	1.768.574	0,62
209.600	EUR	Intesa Sanpaolo	761.276	0,27
7.470	GBP	Wizz Air Holdings	202.507	0,07
Japan			71.856	0,03
2.900	JPY	Integral	71.856	0,03
Kasachstan			3.338.354	1,18
89.872	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1.599.722	0,57
13.755	USD	Kaspi.KZ	1.738.632	0,61
Mexiko			7.860.736	2,79
124.022	USD	BBB Foods	2.949.243	1,05
224.287	MXN	Fomento Economico Mexicano	2.916.638	1,03
1.005.307	MXN	Gentera	1.718.277	0,61
4.571	MXN	Gruma	85.776	0,03
2.860	MXN	Grupo Aeroportuario del Sureste	90.437	0,03
16.971	MXN	Grupo Mexico	100.365	0,04
Peru			186.432	0,07
7.830	USD	Intercorp Financial Services	186.432	0,07
Philippinen			6.658.794	2,36
2.634.600	PHP	Ayala Land	1.511.444	0,54
304.360	PHP	BDO Unibank	836.496	0,30
2.795	PHP	Globe Telecom	87.954	0,03
507.110	PHP	International Container Terminal Services	2.868.647	1,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
1.441.400	PHP	Puregold Price Club	687.175	0,24
2.109.100	PHP	Wilcon Depot	667.078	0,24
Polen			7.194.171	2,55
34.474	PLN	Alior Bank	846.689	0,30
85.774	PLN	Grupa Pracuj	1.449.732	0,51
124.739	EUR	InPost	1.924.447	0,69
11.991	PLN	KRUK	1.332.083	0,47
332	PLN	LPP	1.273.801	0,45
464	PLN	mBank	86.127	0,03
11.416	PLN	ORLEN	186.309	0,07
6.383	PLN	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	94.983	0,03
Rumänien			86.259	0,03
3.021	RON	Societatea De Producere A Energiei Electrice in Hidrocentrale Hidroelectrica	86.259	0,03
Slowenien			4.401.187	1,56
187.796	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	4.401.187	1,56
Südafrika			3.368.085	1,19
18.467	ZAR	Aspen Pharmacare Holdings	213.944	0,08
3.472	ZAR	Bid	84.674	0,03
12.797	ZAR	Capitec Bank Holdings	1.416.322	0,50
126.513	ZAR	Shoprite Holdings	1.653.145	0,58
Südkorea			30.022.710	10,64
1.825	KRW	Hana Financial Group	79.846	0,03
456	KRW	Hyundai Motor	80.276	0,03
6.521	KRW	KB Financial Group	340.521	0,12
19.552	KRW	Kia	1.626.610	0,58
2.149	KRW	NAVER	298.665	0,11
707	KRW	Park Systems	79.720	0,03
12.760	KRW	Samsung Electro-Mechanics	1.420.779	0,50
291.211	KRW	Samsung Electronics	17.478.068	6,19
57.928	KRW	Samsung Electronics – Preference	2.891.559	1,02
14.434	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	3.312.985	1,17
5.400	KRW	Samsung SDI	1.915.320	0,68
2.319	KRW	Shinhan Financial Group	81.305	0,03
10.534	KRW	SK Telecom	417.056	0,15
Schweiz			1.816.521	0,64
25.827	CHF	Galderma Group	1.816.521	0,64
Taiwan			66.282.359	23,50

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
152.000	TWD	Accton Technology	2.177.637	0,77
104.059	TWD	Advantech	1.323.356	0,47
622.000	TWD	ASE Technology Holding	3.012.483	1,07
45.000	TWD	Asia Vital Components	762.104	0,27
3.000	TWD	ASMedia Technology	216.539	0,08
162.000	TWD	Chailease Holding	868.124	0,31
216.000	TWD	Chroma ATE	1.704.189	0,60
265.000	TWD	CTBC Financial Holding	268.283	0,10
18.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	16.965	0,01
127.000	TWD	Delta Electronics	1.359.148	0,48
11.000	TWD	E Ink Holdings	78.023	0,03
67.000	TWD	Eclat Textile	1.145.156	0,41
51.000	TWD	Fortune Electric	1.067.696	0,38
598.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	2.905.588	1,03
26.000	TWD	Jentech Precision Industrial	733.607	0,26
10.000	TWD	Materials Analysis Technology	84.366	0,03
209.000	TWD	MediaTek	7.575.421	2,68
262.000	TWD	Merida Industry	1.739.653	0,62
384.000	TWD	Nanya Technology	811.111	0,29
201.000	TWD	Nien Made Enterprise	2.229.600	0,79
70.000	TWD	Shihlin Electric & Engineering	612.433	0,22
104.187	TWD	Sporton International	838.288	0,30
1.359.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	32.654.896	11,57
17.000	TWD	Taiwan Union Technology	97.208	0,03
16.000	TWD	Unimicron Technology	94.990	0,03
120.000	TWD	Uni-President Enterprises	286.469	0,10
246.000	TWD	United Microelectronics	399.706	0,14
23.650	TWD	Voltronic Power Technology	1.219.320	0,43
Thailand			1.310.143	0,46
162.900	THB	Bangkok Dusit Medical Services	126.123	0,04
884.200	THB	Bangkok Dusit Medical Services Class F	684.582	0,24
92.400	THB	Kasikornbank	314.014	0,11
920.500	THB	Land & Houses	185.424	0,07
Türkei			95.550	0,03
112.409	TRY	Yapi ve Kredi Bankasi	95.550	0,03
Vereinigte Arabische Emirate			1.778.314	0,63

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
76.081	AED	ADNOC Drilling	82.251	0,03
98.569	AED	Burjeel Holdings	79.989	0,03
682.911	AED	Emaar Development	1.524.935	0,54
90.210	AED	Salik	91.139	0,03
USA			4.337.570	1,54
604.815	GBP	Haleon	2.544.993	0,90
1.734	USD	Mastercard	835.042	0,30
7.000	TWD	Parade Technologies	201.228	0,07
2.710	USD	Visa	756.307	0,27
Vietnam			1.656.767	0,59
255.700	VND	FPT	1.207.602	0,43
103.600	VND	Vietnam Dairy Products	282.868	0,10
80.400	VND	Vincom Retail	83.172	0,03
43.300	VND	Vingroup	83.125	0,03
Summe Aktien			200.487.403	71,05
Anleihen				
Argentinien			551.362	0,20
190.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.75 %	99.997	0,04
1.080.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 3.63 %	451.365	0,16
Brasilien			914.578	0,32
2.096.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10,00 %	419.899	0,15
1.610.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10,00 %	317.297	0,11
910.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/33, 10,00 %	177.382	0,06
Kolumbien			670.712	0,24
1.580.000.000	COP	Colombian TES 26/03/31, 7,00 %	352.311	0,13
1.745.100.000	COP	Colombian TES 26/10/50, 7,25 %	318.401	0,11
Tschechische Republik			229.827	0,08
320.000	EUR	CPI Property Group 27/01/31, 1,50 %	229.827	0,08
Ecuador			396.467	0,14
140.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/30, 6,00 %	95.366	0,03
616.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 2,50 %	301.101	0,11

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Ägypten				
330.000	USD	Egypt Government International Bond 31/01/47, 8,50 %	262.683	0,09
Gabun				
330.000	USD	Gabon Government International Bond 06/02/31, 6,63 %	282.373	0,10
Elfenbeinküste				
470.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5,88 %	470.063	0,16
140.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4,88 %	130.705	0,05
Mexiko				
5.700.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8,50 %	318.910	0,11
4.610.000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7,75 %	235.662	0,08
5.870.000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8,00 %	304.646	0,11
Nigeria				
480.000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8,38 %	469.400	0,17
Pakistan				
230.000	USD	Pakistan Government International Bond 08/04/51, 8,88 %	173.898	0,06
Südafrika				
6.500.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8,25 %	286.654	0,10
6.540.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8,88 %	275.777	0,10
1.730.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8,50 %	67.505	0,02
3.870.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9,00 %	151.050	0,05
420.000	USD	Sasol Financing USA 18/03/31, 5,50 %	354.306	0,14
Supranational				
140.000.000	NGN	Asian Development Bank 03/01/25, 20,00%	110.895	0,04
20.000.000	ARS	European Bank for Reconstruction & Development 28/05/24, 175,00 %	20.310	0,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Türkei				
200.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9,25 %	205.326	0,07
Summe Anleihen			6.883.109	2,44
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			207.370.512	73,49

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
Argentinien				
229.000	USD	YPF 17/01/31, 9,50 %	234.100	0,08
Brasilien				
456.361	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7,25 %	413.883	0,15
Ägypten				
1.000.000	EGP	Egypt Treasury Bills 10/12/24, ZCP	17.422	0,01
24.000.000	EGP	Egypt Treasury Bills 18/03/25, ZCP	392.935	0,14
USA				
8.150.300	USD	United States Treasury Bill 04/04/24, ZCP	8.143.230	2,88
7.129.800	USD	United States Treasury Bill 11/04/24, ZCP	7.116.483	2,52
50.900	USD	United States Treasury Bill 18/04/24, ZCP	50.754	0,02
1.014.500	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	1.010.555	0,36
50.700	USD	United States Treasury Bill 09/05/24, ZCP	50.398	0,02
50.700	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	50.349	0,02
50.500	USD	United States Treasury Bill 23/05/24, ZCP	50.095	0,02
1.009.400	USD	United States Treasury Bill 30/05/24, ZCP	1.000.292	0,35
Sambia				
300.000	USD	First Quantum Minerals 01/06/31, 8,63%	291.965	0,10
Summe Anleihen			18.822.461	6,67
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			18.822.461	6,67

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Luxemburg			20.543.553	7,28
100.000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	11.535.001	4,09
3.699	USD	Schroder ISF – China A	430.570	0,15
19.312	USD	Schroder ISF Indian Equity	8.577.982	3,04
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			20.543.553	7,28

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens
Anleihen				
Britische Jungferninseln				
100.339	USD	Noventiq Holdings	-	-
Summe Anleihen			-	-
Summe sonstige Wertpapiere			-	-
Summe Kapitalanlagen			246.736.526	87,44
Sonstiges Nettovermögen			35.430.156	12,56
Nettoinventarwert			282.166.682	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
Argentinien				
388.842	USD	YPF 27/06/29, 8,50 %	358.577	0,47
122.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10,00 %	120.905	0,16
Belgien				
100.000	EUR	Umicore 23/06/25, ZCP	102.558	0,14
Kanada				
200.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3,88 %	207.966	0,27
Frankreich				
300.000	EUR	Accor perpetual, variabel	356.701	0,47
22.616	EUR	Accor 07/12/27, 0,70 %	26.735	0,04
200.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4,25 %	214.967	0,28
200.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4,00 %	151.848	0,20
220.000	EUR	Banijay Entertainment 01/05/29, 7,00 %	249.651	0,33
55.849	EUR	Edenred 14/06/28, ZCP	58.759	0,08
200.000	EUR	Electricite de France perpetual, variabel	234.284	0,31
200.000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5,63 %	214.161	0,28
200.000	EUR	iliad 15/02/29, 5,38 %	219.949	0,29
27.134	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	36.785	0,05
6.102	EUR	SOITEC 01/10/25, ZCP	6.655	0,01
27.886	EUR	Veolia Environnement 01/01/25, ZCP	31.682	0,04
Deutschland				
280.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/05/30, 7,50 %	319.648	0,43
265.000	EUR	Douglas Service 08/04/26, 6,00 %	290.460	0,38
215.000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/28, 8,75 %	251.785	0,33
200.000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7,50 %	222.764	0,29
180.236	EUR	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 30/07/26, 6,00 %	194.510	0,26
230.000	EUR	TUI Cruises 15/05/26, 6,50 %	250.620	0,33
200.000	EUR	WEPA Hygieneprodukte 15/12/27, 2,88 %	202.693	0,27
100.000	EUR	Zalando 06/08/25, 0,05 %	101.631	0,13
100.000	EUR	ZF Europe Finance 31/01/29, 4,75 %	108.616	0,14
Italien				
			1.942.727	2,56

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
210.000	EUR	Cerved Group 15/02/29, variabel	219.066	0,29
100.000	EUR	DiaSorin 05/05/28, ZCP	91.322	0,12
200.000	EUR	Engineering-Ingegneria Informatica 30/09/26, 5,88 %	212.942	0,28
210.000	EUR	Lottomatica 01/06/28, 7,13 %	239.547	0,31
200.000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	216.309	0,29
200.000	EUR	Telecom Italia 15/02/28, 6,88 %	228.649	0,30
Japan			64.325	0,08
10.000.000	JPY	Park24 24/02/28, ZCP	64.325	0,08
Luxemburg			875.754	1,16
200.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3,00 %	177.520	0,23
230.000	EUR	Eurofins Scientific perpetual, variable	260.852	0,35
205.000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6,63 %	225.118	0,30
200.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5,75 %	212.264	0,28
Niederlande			951.751	1,26
300.000	GBP	Boost Newco Borrower 15/01/31, 8,50 %	409.406	0,54
110.000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variabel	119.143	0,16
210.000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3,75 %	213.384	0,28
200.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3,75 %	209.818	0,28
Spanien			855.518	1,13
100.000	EUR	Cellnex Telecom 05/07/28, 0,50 %	112.390	0,15
170.000	EUR	Cirsa Finance International 31/07/28, 7,88 %	194.639	0,26
210.000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4,00 %	220.263	0,30
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	101.783	0,13
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	109.320	0,14
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	117.123	0,15
Schweden			248.184	0,33
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden perpetual, variabel	26.117	0,03
100.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3,88 %	106.449	0,14
100.000	EUR	Verisure Holding 15/10/27, 9,25 %	115.618	0,16

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Vereinigtes Königreich			1.564.000	2,06
200.000	GBP	British Telecommunications 20/12/83, variable	270.207	0,36
195.000	GBP	INEOS Finance 15/05/28, 6,63 %	243.899	0,32
205.000	GBP	Pinewood Finance 30/09/25, 3,25 %	254.892	0,34
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3,50 %	121.110	0,16
215.000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5,25 %	250.281	0,33
200.000	USD	Vodafone Group 03/10/78, variabel	199.797	0,26
110.000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	107.496	0,14
100.000	EUR	Vodafone Group 30/08/84, variabel	116.318	0,15
USA			2.343.562	3,10
265.000	EUR	Allied Universal 01/06/28, 3,63 %	266.076	0,35
200.000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2,13 %	186.515	0,25
5.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5,25 %	3.155	-
66.000	USD	Cigna Group 15/05/29, 5,00 %	66.094	0,09
340.000	EUR	Clarios Global 15/05/26, 4,38 %	365.188	0,49
320.000	EUR	Coty 15/09/28, 5,75 %	358.713	0,48
250.000	EUR	EMRLD Borrower 15/12/30, 6,38 %	284.064	0,37
85.000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5,25 %	82.716	0,11
190.000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5,00 %	160.507	0,21
190.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6,00 %	187.269	0,25
210.000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2,25 %	206.867	0,27
180.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50 %	176.398	0,23
Summe Anleihen			12.645.839	16,69
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			12.645.839	16,69

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
Australien			1.162.968	1,54
30.000	USD	Mineral Resources 01/05/27, 8,13 %	30.371	0,04
60.000	USD	Mineral Resources 01/10/28, 9,25 %	63.208	0,08
125.000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8,50 %	128.979	0,17
218.546	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	142.809	0,19
226.887	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	147.315	0,19
500.000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	325.191	0,44
500.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	325.095	0,43
Belgien			377.347	0,50
400.000	USD	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 5,50 %	377.347	0,50
Bermuda			1.009.831	1,33
100.000	USD	AREIT 17/08/41, variabel	99.874	0,13
400.000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	405.504	0,54
500.000	USD	RR 24 15/01/36, variable	504.453	0,66
Brasilien			554.971	0,73
200.000	USD	Azul Secured Finance 28/05/30, 10,88 %	169.299	0,22
200.000	USD	Braskem Netherlands Finance 23/01/81, variable	200.527	0,27
205.000	USD	Samarco Mineracao 30/06/31, 9,50%	185.145	0,24
Kanada			1.429.242	1,89
198.000	USD	Bombardier 15/06/26, 7,13 %	201.084	0,27
100.000	USD	Bombardier 15/02/28, 6,00 %	98.488	0,13
105.000	USD	Bombardier 15/11/30, 8,75 %	112.262	0,15
405.000	USD	Cascades 15/01/28, 5,38 %	389.434	0,51
23.000	USD	First Majestic Silver 15/01/27, 0,38 %	17.954	0,02
300.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6,00 %	285.353	0,38
179.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7,13 %	179.305	0,24
145.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6,88 %	145.362	0,19
Kaimaninseln			5.278.023	6,97

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	238.483	0,31	550.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	582.158	0,77
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	249.615	0,33	250.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	312.705	0,41
1.124.599	USD	Falcon Aerospace 15/09/39, 6,66 %	466.720	0,62	102.507	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	102.795	0,14
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	327.900	0,43	98.536	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	116.810	0,15
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	349.109	0,46	107.404	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	125.270	0,17
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	247.054	0,33	375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	401.411	0,53
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	244.379	0,32	800.000	EUR	ICG Euro CLO 19/04/36, variabel	879.535	1,17
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	244.989	0,32	100.000	GBP	Last Mile Logistics CMBS UK DAC 17/08/33, variabel	126.253	0,17
448.849	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3,97 %	415.676	0,55	174.770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	176.437	0,23
1.116.071	USD	Thunderbolt II Aircraft Lease 15/09/38, variabel	783.124	1,03	550.821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	563.887	0,74
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	368.284	0,49	375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	397.621	0,52
1.000.000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	970.486	1,29	300.000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variabel	319.370	0,42
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	372.204	0,49	375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	403.163	0,53
Chile			28.892	0,04	250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	266.290	0,35
25.000	USD	Latam Airlines Group 15/10/29, 13,38 %	28.892	0,04	310.000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variabel	364.466	0,48
China			16.221	0,02	191.173	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	235.392	0,31
14.000	USD	H World Group 01/05/26, 3,00 %	16.221	0,02	500.000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variabel	532.982	0,70
Dänemark			11.555	0,02	375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	385.928	0,51
10.000	USD	Ascendis Pharma 01/04/28, 2,25 %	11.555	0,02	Israel			13.618	0,02
Hongkong			210.522	0,28	13.000	USD	Nice 15/09/25, ZCP	13.618	0,02
240.000	USD	Seaspan 01/08/29, 5,50 %	210.522	0,28	Jersey, Kanalinseln			502.224	0,66
Indien			241.967	0,32	500.000	USD	ICG US CLO 18/07/36, variabel	502.224	0,66
94.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13,88 %	88.438	0,12	Luxemburg			298.433	0,39
168.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13,88 %	153.529	0,20	325.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5,75 %	298.433	0,39
Irland			8.295.687	10,94	Mexiko			155.455	0,21
375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	402.210	0,53	200.000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6,99 %	155.455	0,21
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	797.829	1,05					
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variabel	803.175	1,06					

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen					
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen					
Singapur						49.719	0,07			
5.000	USD	Sea 01/12/25, 2,38 %		5.025	0,01	305.000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5,25 %	199.459	0,26
52.000	USD	Sea 15/09/26, 0,25 %		44.694	0,06	240.000	USD	B&G Foods 15/09/28, 8,00 %	250.210	0,33
Vereinigtes Königreich						113.595	0,15			
100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4,88 %		113.595	0,15	50.000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6,13 %	31.202	0,04
USA						38.287.389	50,53			
195.000	USD	Academy 15/11/27, 6,00 %		192.795	0,25	55.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4,88 %	30.067	0,04
300.000	USD	Acuris Finance US 01/05/28, 5,00 %		272.823	0,36	375.000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7,00 %	386.690	0,51
12.000	USD	Advanced Energy Industries 15/09/28, 2,50 %		12.263	0,02	280.137	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2,44 %	246.983	0,33
14.000	USD	Akamai Technologies 01/09/27, 0,38 %		14.805	0,02	15.000	USD	Blackline 15/03/26, ZCP	13.647	0,02
29.000	USD	Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP		26.695	0,04	370.000	USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5,13 %	344.100	0,45
310.000	USD	Albertsons 15/02/28, 5,88 %		307.142	0,41	135.000	USD	Boost Newco Borrower 15/01/31, 7,50 %	141.492	0,19
60.000	USD	Albertsons 15/02/30, 4,88 %		57.130	0,08	6.000	USD	Bridgebio Pharma 15/03/27, 2,50 %	6.458	0,01
82.000	USD	Alliant Energy 15/03/26, 3,88 %		81.057	0,11	11.000	USD	Bridgebio Pharma 01/02/29, 2,25 %	9.013	0,01
135.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4,63 %		123.457	0,16	320.000	USD	Brinker International 15/07/30, 8,25 %	337.429	0,45
115.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6,63 %		115.055	0,15	250.000	USD	BRSP 19/08/38, variabel	227.323	0,30
170.000	USD	Allied Universal Holdco 15/02/31, 7,88 %		172.430	0,23	10.000	USD	Burlington Stores 15/12/27, 1,25 %	12.780	0,02
7.000	USD	Anylam Pharmaceuticals 15/09/27, 1,00 %		6.614	0,01	14.000	USD	Cable One 15/03/26, ZCP	12.264	0,02
15.000	USD	Alphatec Holdings 01/08/26, 0,75 %		15.656	0,02	125.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/27, 3,88 %	112.361	0,15
75.000	USD	AMC Networks 15/01/29, 10,25 %		75.516	0,10	235.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5,63 %	196.517	0,26
275.000	USD	AMC Networks 15/02/29, 4,25 %		195.018	0,26	415.000	USD	Calpine 01/02/29, 4,63 %	384.512	0,51
39.000	USD	American Water Capital 15/06/26, 3,63 %		38.230	0,05	240.000	USD	Calpine 01/02/31, 5,00 %	220.376	0,29
255.000	USD	Amsted Industries 01/07/27, 5,63 %		251.383	0,33	165.000	USD	Carnival 01/05/29, 6,00 %	162.842	0,21
90.000	USD	APX Group 15/02/27, 6,75 %		90.397	0,12	260.000	USD	Carnival 01/06/30, 10,50 %	284.583	0,38
250.000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel		237.197	0,31	265.653	USD	Castlelake Aircraft Structured Trust 2017-1R 15/08/41, 2,74 %	245.278	0,32
290.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4,13 %		262.907	0,35	105.000	USD	CCO Holdings 01/03/30, 4,75 %	90.436	0,12
103.000	USD	AREIT Trust 14/09/36, variabel		98.577	0,13	455.000	USD	CCO Holdings 01/06/33, 4,50 %	355.786	0,47
9.000	USD	Array Technologies 01/12/28, 1,00 %		8.355	0,01	350.000	USD	Central Parent 15/06/29, 8,00 %	363.049	0,48
								Cheesecake Factory 15/06/26, 0,38 %	9.844	0,01
								Churchill Downs 01/05/31, 6,75 %	538.702	0,70
								CITGO Petroleum 15/06/25, 7,00 %	329.908	0,44
								Citigroup 13/02/30, variabel	34.868	0,05

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
135.000	USD	Civitas Resources 01/11/30, 8,63 %	145.057	0,19	405.000	USD	Edgewell Personal Care 01/04/29, 4,13 %	371.883	0,49
110.000	USD	Clear Channel Outdoor Holdings 01/04/30, 7,88 %	109.442	0,14	26.000	USD	Envestnet 01/12/27, 2,63 %	27.599	0,04
460.000	USD	Cloud Software Group 31/03/29, 6,50 %	437.056	0,58	510.000	USD	EquipmentShare,com 15/05/28, 9,00 %	525.861	0,69
17.000	USD	Cloudflare 15/08/26, ZCP	15.976	0,02	41.000	USD	ERAC USA Finance 15/02/29, 5,00 %	41.121	0,05
390.000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7,00 %	388.528	0,51	6.000	USD	Etsy 01/10/26, 0,13 %	6.372	0,01
141.000	USD	COLT Mortgage Loan Trust 25/02/69, variable	139.899	0,18	16.000	USD	Etsy 15/06/28, 0,25 %	12.640	0,02
45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7,13 %	17.922	0,02	322.000	USD	Everi Holdings 15/07/29, 5,00 %	319.212	0,42
225.000	USD	CommScope 01/09/29, 4,75 %	161.438	0,21	13.000	USD	Evolent Health 01/12/29, 3,50 %	14.960	0,02
145.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6,00 %	126.288	0,17	4.000	USD	Exact Sciences 01/03/30, 2,00 %	4.532	0,01
40.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5,63 %	36.823	0,05	275.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/29, 4,63 %	252.457	0,33
30.000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6,00 %	26.229	0,03	90.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6,75 %	80.855	0,11
180.000	USD	Community Health Systems 15/01/32, 10,88 %	185.720	0,25	285.000	USD	Fiesta Purchaser 01/03/31, 7,88 %	294.537	0,39
240.000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/01/32, 5,00 %	214.752	0,28	560.000	USD	FirstCash 01/01/30, 5,63 %	532.813	0,70
35.000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5,88 %	31.737	0,04	100.749	USD	Five Point Operating 15/01/28, 10,50 %	103.813	0,14
380.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6,50 %	332.889	0,44	17.000	USD	Five9 15/03/29, 1,00 %	17.638	0,02
127.000	USD	Coty 15/04/26, 6,50 %	127.290	0,17	11.000	USD	Fluor 15/08/29, 1,13 %	12.411	0,02
395.000	USD	CQP 15/06/31, 5,50 %	373.481	0,49	400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	353.054	0,47
75.000	USD	CQP Holdco 15/12/33, 7,50 %	77.183	0,10	29.000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	30.117	0,04
265.000	USD	CSC Holdings 01/02/28, 5,38 %	228.614	0,30	260.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9,75 %	269.444	0,36
240.000	USD	CSC Holdings 01/12/30, 4,13 %	171.729	0,23	295.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5,50 %	286.112	0,38
240.000	USD	CSC Holdings 15/11/31, 4,50 %	170.114	0,22	170.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/12/30, 7,88 %	178.698	0,24
290.000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 01/09/31, 8,88 %	306.796	0,40	210.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5,00 %	195.088	0,26
125.000	USD	CVR Energy 15/02/28, 5,75 %	117.482	0,16	170.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6,75 %	151.745	0,20
45.000	USD	Dayforce 15/03/26, 0,25 %	41.400	0,05	195.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7,13 %	177.024	0,23
325.000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5,88 %	307.788	0,41	10.000	USD	Green Plains 15/03/27, 2,25 %	10.244	0,01

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
16.000	USD	Haemonetics 01/03/26, ZCP	14.770	0,02	20.000	USD	Marriott Vacations Worldwide 15/12/27, 3,25 %	18.860	0,02
13.000	USD	Halozyme Therapeutics 15/08/28, 1,00 %	12.663	0,02	340.000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5,25 %	321.562	0,42
225.000	USD	Hanesbrands 15/02/31, 9,00 %	231.397	0,31	17.000	USD	Merit Medical Systems 01/02/29, 3,00 %	18.590	0,02
200.000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6,00 %	199.355	0,26	295.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5,00 %	283.536	0,37
375.000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3,38 %	353.636	0,47	9.000	USD	MP Materials 01/04/26, 0,25 %	7.943	0,01
80.000	USD	HAT Holdings I 15/09/30, 3,75 %	67.283	0,09	6.000	USD	MP Materials 01/03/30, 3,00 %	5.622	0,01
450.000	USD	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 01/06/29, 5,00 %	420.355	0,55	155.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5,50 %	131.981	0,17
285.000	USD	Howard Midstream Energy Partners 15/07/28, 8,88 %	300.885	0,40	235.000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/08/28, 5,50 %	225.223	0,30
340.000	USD	HUB International 15/06/30, 7,25 %	349.769	0,46	120.000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/11/31, 5,75 %	110.815	0,15
350.000	USD	Hunt 15/04/29, 5,25 %	320.485	0,42	258.408	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	257.076	0,34
405.000	USD	Imola Merger 15/05/29, 4,75 %	380.161	0,50	15.000	USD	NCL 15/02/27, 1,13 %	14.222	0,02
6.000	USD	Insmed 01/06/28, 0,75 %	6.441	0,01	340.000	USD	NCR Atleos Escrow 01/04/29, 9,50 %	364.016	0,48
185.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5,25 %	179.158	0,24	105.000	USD	NCR 01/10/28, 5,00 %	97.917	0,13
180.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5,00 %	172.446	0,23	245.000	USD	NCR 15/04/29, 5,13 %	227.502	0,30
345.000	USD	JB Poindexter 15/12/31, 8,75 %	357.017	0,47	210.000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4,50 %	179.798	0,24
4.000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0,50 %	3.512	-	500.000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9,29 %	473.278	0,62
495.000	USD	Kennedy-Wilson 01/02/30, 4,75 %	395.706	0,52	20.000	USD	NextEra Energy Capital Holdings 01/03/27, 3,00 %	21.430	0,03
380.000	USD	Kodiak Gas Services 15/02/29, 7,25 %	387.446	0,51	12.000	USD	NRG Energy 01/06/48, 2,75 %	19.884	0,03
145.000	USD	LABL 01/11/28, 5,88 %	133.607	0,18	25.000	USD	Nutanix 01/10/27, 0,25 %	30.750	0,04
11.000	USD	Lantheus Holdings 15/12/27, 2,63 %	12.207	0,02	370.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4,25 %	336.177	0,44
375.000	USD	LCM Investments Holdings II 01/08/31, 8,25 %	392.569	0,52	135.000	USD	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9,75 %	143.970	0,19
375.000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4,25 %	181.605	0,24	17.000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0,50 %	16.813	0,02
14.000	USD	Liberty Media-Liberty Formula One 15/08/27, 2,25 %	14.387	0,02	290.000	USD	OneMain Finance 15/03/26, 7,13 %	295.618	0,39
12.000	USD	LivaNova USA 15/12/25, 3,00 %	13.680	0,02	13.000	USD	PagerDuty 15/10/28, 1,50 %	13.894	0,02
21.000	USD	Live Nation Entertainment 15/01/29, 3,13 %	25.292	0,03	27.000	USD	Pebblebrook Hotel Trust 15/12/26, 1,75 %	24.351	0,03
10.000	USD	Lyft 01/03/29, 0,63 %	11.731	0,02	390.000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5,38 %	354.668	0,47
600.000	USD	Marriott Ownership Resorts 15/06/29, 4,50 %	549.209	0,71					

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
28.000	USD	Perficient 15/11/26, 0,13 %	24.271	0,03	17.000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	15.649	0,02
205.000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5,50 %	201.330	0,27	55.000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4,75 %	52.532	0,07
125.000	USD	Permian Resources Operating 15/02/26, 7,75 %	126.728	0,17	170.000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4,38 %	152.893	0,20
105.000	USD	Permian Resources Operating 15/01/32, 7,00 %	108.997	0,14	110.000	USD	STL Holding 15/02/29, 8,75 %	112.998	0,15
21.000	USD	PG&E 01/12/27, 4,25 %	21.121	0,03	425.000	USD	Talen Energy Supply 01/06/30, 8,63 %	454.796	0,60
360.000	USD	Pike 31/01/31, 8,63 %	383.019	0,51	80.000	USD	Tenet Healthcare 01/10/28, 6,13 %	79.875	0,11
14.000	USD	Post Holdings 15/08/27, 2,50 %	15.778	0,02	12.000	USD	Tetra Tech 15/08/28, 2,25 %	13.208	0,02
200.000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5,63 %	196.594	0,26	95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6,25 %	86.908	0,11
480.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6,25 %	470.916	0,62	40.000	USD	Tronox 15/03/29, 4,63 %	35.933	0,05
11.000	USD	Progress Software 15/04/26, 1,00 %	11.440	0,02	105.000	USD	Uber Technologies 15/09/27, 7,50 %	107.587	0,14
293.416	USD	PRPM 25/06/26, variabel	286.039	0,38	110.000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6,25 %	110.544	0,15
200.000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	189.518	0,25	12.000	USD	Uber Technologies 01/12/28, 0,88 %	14.874	0,02
100.000	USD	PRPM Trust Series 2024- B1 25/12/68, variabel	97.830	0,13	1.330.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	1.325.222	1,75
120.000	USD	PRPM Trust Series 2024- M1 25/12/68, variabel	119.972	0,16	34.000	USD	Unity Software 15/11/26, ZCP	28.985	0,04
25.000	USD	QVC 15/02/27, 4,75 %	22.282	0,03	165.000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7,38 %	163.161	0,22
10.000	USD	Rexford Industrial Realty 15/03/29, 4,13 %	10.130	0,01	80.000	USD	US Foods 01/06/30, 4,63 %	74.339	0,10
14.000	USD	Seagate HDD Cayman 01/06/28, 3,50 %	17.871	0,02	170.000	USD	Venture Global LNG 01/02/29, 9,50 %	183.242	0,24
250.000	USD	Service Properties Trust 15/11/31, 8,63 %	266.910	0,35	105.000	USD	Venture Global LNG 01/06/31, 8,38 %	108.353	0,14
33.000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	30.051	0,04	400.000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	391.757	0,52
23.000	USD	Shift4 Payments 01/08/27, 0,50 %	21.448	0,03	271.000	USD	Verus Securitization Trust 25/06/68, variabel	271.168	0,36
11.000	USD	Shockwave Medical 15/08/28, 1,00 %	14.094	0,02	91.293	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/08/68, variabel	91.986	0,12
535.000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5,50 %	509.887	0,67	1.134.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/08/68, variabel	1.136.024	1,49
240.000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5,50 %	234.659	0,31	100.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-M1 25/08/68, variabel	100.654	0,13
410.000	USD	SK Invictus Intermediate II 30/10/29, 5,00 %	366.165	0,48	189.484	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/09/68, variabel	191.221	0,25
4.000	USD	SoFi Technologies 15/03/29, 1,25 %	4.036	0,01	174.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/09/68, variabel	173.051	0,23
28.000	USD	SolarEdge Technologies 15/09/25, ZCP	25.656	0,03					
2.000	USD	Spirit AeroSystems 01/11/28, 3,25 %	2.808	-					
295.000	USD	Spirit AeroSystems 15/11/30, 9,75 %	330.377	0,44					

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
100.000	USD	Vistra Operations 15/10/31, 7,75 %	104.793	0,14
130.000	USD	Vital Energy 15/04/32, 7,88 %	132.295	0,17
121.000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5,50 %	116.168	0,15
189.000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	162.585	0,21
520.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	455.130	0,60
185.000	USD	Wand NewCo 3 30/01/32, 7,63 %	191.547	0,25
370.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5,75 %	361.942	0,48
375.000	USD	Watco 15/06/27, 6,50 %	371.028	0,49
364.221	USD	WAVE Trust 15/11/42, 3,84 %	321.835	0,42
13.000	USD	Wayfair 15/08/26, 1,00 %	12.049	0,02
3.000	USD	Western Digital 15/11/28, 3,00 %	4.404	0,01
180.000	USD	Windsor Holdings III 15/06/30, 8,50 %	188.914	0,25
Summe Anleihen			58.037.659	76,61
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			58.037.659	76,61

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Kaimaninseln			587.845	0,78
668.020	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4,46 %	587.845	0,78
China			29.714	0,04
200.000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5,60 %*	6.430	0,01
200.000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4,60 %*	8.000	0,01
200.000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3,25 %	15.284	0,02
Irland			2.247.029	2,96
750.000	EUR	Aurium CLO 18/01/38, variabel	819.210	1,08
500.000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	513.458	0,68
250.000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	270.439	0,36
500.000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	538.033	0,70
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	105.889	0,14
Summe Anleihen			2.864.588	3,78
Summe sonstige Wertpapiere			2.864.588	3,78
Summe Kapitalanlagen			73.548.086	97,08
Sonstiges Nettovermögen			2.209.898	2,92
Nettoinventarwert			75.757.984	100,00

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA SEG US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Aktien				
Kanada			3.656.160	1,01
47.378	USD	Shopify	3.656.160	1,01
USA			305.479.167	84,31
28.856	USD	Amphenol	3.328.540	0,92
211.281	USD	Brown & Brown	18.495.539	5,10
67.316	USD	CDW	17.218.086	4,75
38.405	USD	Clean Harbors	7.731.311	2,13
297.491	USD	Core & Main	17.031.360	4,70
307.599	USD	Dayforce	20.366.130	5,62
46.780	USD	EMCOR Group	16.382.356	4,52
82.080	USD	Entegris	11.535.523	3,18
74.785	USD	ITT	10.173.004	2,81
245.743	USD	Live Nation Entertainment	25.992.236	7,18
33.974	USD	Martin Marietta Materials	20.857.998	5,76
105.864	USD	Middleby	17.021.873	4,70
14.283	USD	Paychex	1.753.952	0,48
10.866	USD	PTC	2.053.022	0,57
79.251	USD	Revvity	8.321.355	2,30
106.866	USD	Rollins	4.944.690	1,36
93.065	USD	Service International	6.906.354	1,91
163.234	USD	Signet Jewelers	16.334.826	4,51
18.039	USD	Teledyne Technologies	7.744.503	2,14
427.561	USD	Tempur Sealy International	24.294.015	6,71
109.576	USD	Toro	10.040.449	2,77
197.673	USD	Trimble	12.722.234	3,51
37.777	USD	Vail Resorts	8.417.849	2,32
108.539	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	15.811.962	4,36
Summe Aktien			309.135.327	85,32
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			309.135.327	85,32

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
USA			4.912.917	1,36
5.000.000	USD	United States Treasury Bill 08/08/24, ZCP	4.912.917	1,36
Summe Anleihen			4.912.917	1,36
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			4.912.917	1,36
Summe Kapitalanlagen			314.048.244	86,68
Sonstiges Nettovermögen			48.275.503	13,32
Nettoinventarwert			362.323.747	100,00

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Aktien				
Schweiz			8.237.381	4,36
98.900	USD	Alcon	8.237.381	4,36
Taiwan			5.399.144	2,86
39.685	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	5.399.144	2,86
USA			124.961.423	66,17
31.216	USD	Abbott Laboratories	3.548.011	1,88
3.485	USD	Adobe	1.758.531	0,93
18.276	USD	Advanced Micro Devices	3.298.635	1,75
2.468	USD	Alphabet	372.495	0,20
24.647	USD	Amazon.com	4.445.826	2,35
2.411	USD	American Express	548.961	0,29
476	USD	Analog Devices	94.148	0,05
19.350	USD	Banc of California	445.437	0,24
11.781	USD	Becton Dickinson	2.915.208	1,54
66.680	USD	Boston Scientific	4.566.913	2,42
118.565	USD	Carlyle Group	5.561.884	2,95
10.061	USD	Clean Harbors	2.025.380	1,07
114.486	USD	Clear Secure	2.435.117	1,29
13.121	USD	CONMED	1.050.730	0,56
8.190	USD	Constellation Brands	2.225.714	1,18
1.853	USD	CyberArk Software	492.212	0,26
55.929	USD	Delta Air Lines	2.677.321	1,42
4.881	USD	DocuSign	290.664	0,15
5.040	USD	Eli Lilly	3.920.918	2,08
39.555	USD	General Electric	6.943.090	3,67
33.322	USD	Global Payments	4.453.819	2,36
100.824	USD	Globus Medical	5.408.199	2,86
3.354	USD	HCA Healthcare	1.118.660	0,59
38.837	USD	HEICO	5.978.568	3,17
6.786	USD	Inari Medical	325.592	0,17
27.256	USD	Ingersoll Rand	2.587.957	1,37
51.417	USD	Intel	2.271.089	1,20
1.154	USD	Intuit	750.100	0,40
423	USD	KLA	295.495	0,16
10.066	USD	Lantheus Holdings	626.508	0,33
1.400	USD	Marriott International	353.234	0,19
27.463	USD	Medtronic	2.393.400	1,27
9.500	USD	Meta Platforms	4.613.010	2,44
11.156	USD	Microsoft	4.693.552	2,49
4.693	USD	Natera	429.222	0,23
4.203	USD	NVIDIA	3.797.663	2,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
12.336	USD	Old Dominion Freight Line	2.705.408	1,43
30.414	USD	PACCAR	3.767.990	2,00
1.158	USD	Palo Alto Networks	329.023	0,17
1.745	USD	Procter & Gamble	283.126	0,15
738	USD	PVH	103.770	0,05
90.296	USD	Riskified	488.501	0,26
10.841	USD	Roper Technologies	6.080.067	3,21
1.756	USD	Ross Stores	257.711	0,14
20.952	USD	Royal Caribbean Cruises	2.912.538	1,54
3.059	USD	S&P Global	1.301.452	0,69
871	USD	Sherwin-Williams	302.524	0,16
1.026	USD	Simply Good Foods	34.915	0,02
1.583	USD	Skechers USA	96.975	0,05
67.090	USD	Smartsheet	2.582.965	1,37
14.389	USD	Tenable Holdings	711.248	0,38
5.409	USD	Tenet Healthcare	568.540	0,30
11.931	USD	T-Mobile US	1.947.378	1,03
23.851	USD	Uber Technologies	1.836.288	0,97
15.576	USD	Union Pacific	3.830.606	2,03
5.596	USD	US Foods Holding	302.016	0,16
3.751	USD	Walmart	225.698	0,12
11.140	USD	Waste Connections	1.916.191	1,01
32.999	USD	Wells Fargo	1.912.622	1,01
2.752	USD	Workday	750.608	0,40
Summe Aktien			138.597.948	73,39
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			138.597.948	73,39

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
USA			34.757.333	18,41
35.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	34.757.333	18,41
Summe Anleihen			34.757.333	18,41
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			34.757.333	18,41
Summe Kapitalanlagen			173.355.281	91,80
Sonstiges Nettovermögen			15.484.340	8,20
Nettoinventarwert			188.839.621	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
Deutschland				
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4,25 %	13.228	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4,75 %	14.063	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3,25 %	12.001	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2,50 %	10.816	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2,50 %	10.840	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1,25 %	8.439	-
USA			22.565	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2,50 %	7.328	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3,00 %	7.989	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2,50 %	7.248	-
Summe Anleihen			91.952	0,02
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			91.952	0,02

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
USA				
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2,88 %	7.800	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3,00 %	7.959	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2,50 %	7.230	-
Summe Anleihen			22.989	0,01
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			22.989	0,01
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag				
Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen				
Markt- wert USD				
% Netto- ver- mögen				
Luxemburg				
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	1,30
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			5.000.000	1,30
Summe Kapitalanlagen			5.114.941	1,33
Termineinlagen				
Finanzwesen				
240.837.000			62,61	
56.000.000	USD	Banque NA 01/04/24, 5,30 %	56.000.000	14,55
55.000.000	USD	Credit Agricole 01/04/24, 5,30 %	55.000.000	14,30
55.837.000	USD	JPMorgan Chase Bank 01/04/24, 5,30 %	55.837.000	14,52
18.000.000	USD	Mizuho Bank 01/04/24, 5,32 %	18.000.000	4,68
56.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank 01/04/24, 5,30 %	56.000.000	14,56
Summe Termineinlagen			240.837.000	62,61
Sonstiges Nettovermögen			138.683.377	36,06
Nettoinventarwert			384.635.318	100,00

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Aktien				
Australien				
193.771	GBP	Glencore	1.064.605	0,33
Österreich				
16.494	EUR	Addiko Bank	319.412	0,10
22.819	EUR	BAWAG Group	1.445.094	0,46
5.963	EUR	Erste Group Bank	265.690	0,08
Belgien				
3.025	USD	Galapagos	97.405	0,03
4.464	EUR	KBC Group	334.326	0,10
492	EUR	UCB	60.723	0,02
Brasilien				
117.488	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	86.674	0,03
23.000	BRL	Rede D'Or Sao Luiz	116.069	0,03
Kanada				
124.298	CAD	Advantage Energy	906.622	0,28
114.624	CAD	ARC Resources	2.043.608	0,65
6.318	USD	Canadian Natural Resources	482.190	0,15
34.615	USD	Cenovus Energy	691.954	0,22
3.200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-
13.529	CAD	Crew Energy	46.443	0,01
76.952	CAD	Enerplus	1.511.714	0,48
12.497	CAD	Headwater Exploration	70.763	0,02
71.681	CAD	Kelt Exploration	320.158	0,10
22.518	CAD	MEG Energy	517.006	0,16
74.604	CAD	NuVista Energy	654.310	0,21
90.877	CAD	Peyto Exploration & Development	1.001.656	0,31
6.042	CAD	Rogers Communications	247.559	0,08
2.823	USD	Shopify	217.851	0,07
1.467	USD	Teck Resources	67.159	0,02
4.233	USD	Xenon Pharmaceuticals	182.231	0,06
Chile				
4.821	CAD	Lundin Mining	49.329	0,02
China				
17.777	HKD	Alibaba Group Holding	159.557	0,05
2.600	CNH	Contemporary Amperex Technology	67.586	0,02
337.000	HKD	CSC Financial	255.325	0,08
5.488	HKD	ENN Energy Holdings	42.281	0,01
8.785	USD	KE Holdings	120.618	0,04
7.000	HKD	Keymed Biosciences	30.319	0,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
69.000	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	43.021	0,01
7.400	HKD	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical	146.546	0,05
6.264	HKD	Tencent Holdings	243.136	0,08
4.900	CNH	WuXi AppTec	31.732	0,01
4.651	USD	Zai Lab	74.509	0,02
Dänemark				
181.520	DKK	Alm Brand	345.510	0,11
2.707	USD	Ascendis Pharma	409.217	0,13
522	DKK	Genmab	157.343	0,05
5.966	DKK	Topdanmark	254.557	0,08
Frankreich				
10.087	EUR	ALD	71.279	0,02
967	EUR	Dassault Aviation	212.823	0,07
2.387	EUR	Engie	39.942	0,01
5.791	EUR	Legrand	613.641	0,19
824	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	741.136	0,23
7.699	EUR	Renault	388.682	0,12
58.529	EUR	Société Générale	1.566.603	0,50
2.483	EUR	TotalEnergies	170.022	0,05
5.597	EUR	Ubisoft Entertainment	117.778	0,04
Deutschland				
889	EUR	Allianz	266.437	0,08
41.604	EUR	Commerzbank	571.379	0,18
43.762	EUR	Deutsche Bank	688.455	0,22
21.654	USD	Immatics	227.584	0,07
752	EUR	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft in München	366.949	0,12
648	EUR	Rheinmetall	364.228	0,11
1.641	EUR	RWE	55.697	0,02
3.480	EUR	SAP	677.519	0,21
97.954	GBP	Sirius Real Estate	121.098	0,04
9.463	EUR	Talanx	749.352	0,23
Griechenland				
128.905	EUR	Piraeus Financial Holdings	539.032	0,17
Irland				
110.285	EUR	AIB Group	559.686	0,17
4.571	USD	Prothena	113.224	0,04
Italien				
38.644	EUR	Banca Mediolanum	424.415	0,13
155.996	EUR	Banca Monte dei Paschi di Siena	706.844	0,22

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
74.867	EUR	Banco BPM	498.191	0,16
4.020	EUR	BFF Bank	53.779	0,02
1.664	EUR	DiaSorin	160.671	0,05
27.916	EUR	FinecoBank Banca Fineco	418.177	0,13
2.170	USD	Stevanato Group	69.657	0,02
26.407	EUR	UniCredit	1.002.107	0,32
Japan			5.138.514	1,61
4.633	JPY	Bank of Nagoya	198.015	0,06
50.876	JPY	Chiba Bank	422.622	0,13
8.735	JPY	Chugai Pharmaceutical	332.712	0,10
61.758	JPY	Concordia Financial Group	309.728	0,10
2.684	JPY	Daiichi Sankyo	85.070	0,03
3.700	JPY	Hachijuni Bank	24.894	0,01
4.000	JPY	Hokuhoku Financial Group	50.469	0,02
39.712	JPY	Japan Post Insurance	758.012	0,23
3.316	JPY	M&A Capital Partners	48.914	0,02
67.303	JPY	Mebuki Financial Group	220.475	0,07
7.000	JPY	Otsuka Holdings	289.979	0,09
24.443	JPY	Rakuten Bank	486.826	0,15
26.993	JPY	Shiga Bank	743.565	0,23
4.565	JPY	Sony Group	389.916	0,12
9.700	JPY	Sumitomo Mitsui Financial Group	565.929	0,18
5.800	JPY	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	124.828	0,04
35.900	JPY	Tochigi Bank	86.560	0,03
Jersey			1.563.887	0,49
29.177	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1.563.887	0,49
Macau			178.868	0,06
107.032	HKD	MGM China Holdings	178.868	0,06
Niederlande			2.036.298	0,64
1.155	USD	Argenx	454.747	0,14
228	USD	ASML Holding	221.267	0,07
43.920	EUR	ING Groep	722.403	0,23
5.881	USD	Merus	264.821	0,08
11.260	GBP	Shell	373.060	0,12
Norwegen			495.303	0,16
4.686	USD	Seadrill	235.706	0,08
14.823	NOK	Storebrand	136.536	0,04
11.303	NOK	TGS	123.061	0,04
Singapur			193.546	0,06
61.639	USD	Grab Holdings	193.546	0,06
Südkorea			187.362	0,06
126	USD	Samsung Electronics	187.362	0,06

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
Spanien			2.127.848	0,67
327.330	EUR	Banco de Sabadell	513.819	0,16
60.964	EUR	Iberdrola	756.037	0,24
411.509	EUR	Linea Directa Aseguradora Cia de Seguros y Reaseguros	410.660	0,13
8.419	EUR	Merlin Properties Socimi	90.601	0,03
288.281	EUR	Unicaja Banco	356.731	0,11
Schweden			231.002	0,07
13.775	SEK	Fabege	128.819	0,04
5.152	SEK	Swedbank	102.183	0,03
Schweiz			1.794.359	0,56
4.240	CHF	Alcon	351.386	0,11
3.284	CHF	Galderma Group	230.683	0,07
4.234	CHF	Novartis	410.184	0,13
10.977	USD	On Holding	388.366	0,12
13.451	CHF	UBS Group	413.740	0,13
Vereinigtes Königreich			5.449.775	1,71
7.644	GBP	AstraZeneca	1.030.199	0,33
19.520	USD	Autolus Therapeutics	124.538	0,04
53.135	GBP	Aviva	333.042	0,10
423.997	GBP	Barclays	980.390	0,31
40.202	GBP	Beazley	337.681	0,11
31.588	GBP	BP	197.630	0,06
102.315	GBP	Deliveroo	152.769	0,05
20.825	GBP	Entain	209.591	0,07
334	GBP	Genus	7.441	-
1.422	USD	Immunocore Holdings	92.430	0,03
18.102	GBP	Intermediate Capital Group	469.286	0,15
328.176	GBP	Lloyds Banking Group	214.394	0,07
108.902	GBP	NewRiver Real Estate Investment Trust	111.198	0,03
12.524	GBP	Segro	142.865	0,04
68.902	GBP	Standard Chartered	583.880	0,18
8.506	USD	Verona Pharma	136.862	0,04
27.779	GBP	Wise	325.579	0,10
USA			63.811.843	20,06
3.273	USD	Abbott Laboratories	372.009	0,12
697	USD	Abercrombie & Fitch	87.355	0,03
3.412	USD	Acadia Healthcare	270.299	0,08
1.140	USD	Addus HomeCare	117.808	0,04
35.112	USD	agilon health	214.183	0,07
11.982	USD	Akero Therapeutics	302.665	0,10
580	USD	Align Technology	190.194	0,06
21.142	USD	Alignment Healthcare	104.864	0,03
11.391	USD	Alkermes	308.354	0,10

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
1.743	USD	Alliant Energy	87.847	0,03	4.039	USD	Edison International	285.678	0,09
4.023	USD	Alnylam Pharmaceuticals	601.237	0,19	2.123	USD	Elanco Animal Health	34.562	0,01
4.627	USD	Alphabet	698.353	0,22	660	USD	Elastic	66.158	0,02
6.592	USD	Amazon.com	1.189.065	0,37	5.254	USD	elf Beauty	1.029.942	0,32
3.387	USD	American Electric Power	291.621	0,09	990	USD	Eli Lilly	770.180	0,24
12.029	USD	American Express	2.738.883	0,87	617	USD	Enphase Energy	74.645	0,02
47.716	USD	Antero Resources	1.383.764	0,43	1.237	USD	EOG Resources	158.138	0,05
7.125	USD	Apellis Pharmaceuticals	418.808	0,13	27.818	USD	EQT	1.031.213	0,32
951	USD	Apogee Therapeutics	63.194	0,02	13.946	USD	Equitrans Midstream	174.186	0,05
18.361	USD	Ares Management	2.441.646	0,78	657	USD	Evercore	126.532	0,04
4.544	USD	Atmos Energy	540.145	0,17	6.652	USD	Exact Sciences	459.387	0,14
4.863	USD	AtriCure	147.932	0,05	6.125	USD	Exelon	230.116	0,07
5.050	USD	AZEK	253.611	0,08	327	USD	Expedia Group	45.044	0,01
14.078	USD	Bank of America	533.838	0,17	7.263	USD	Exxon Mobil	844.251	0,27
996	USD	Biogen	214.767	0,07	2.125	USD	First Solar	358.700	0,11
2.166	USD	BJ's Wholesale Club Holdings	163.858	0,05	19.116	USD	Flex	546.909	0,17
833	USD	Block	70.455	0,02	2.557	USD	Freeport-McMoRan	120.230	0,04
2.018	USD	Blueprint Medicines	191.427	0,06	149	USD	Freshpet	17.263	0,01
888	USD	Builders FirstSource	185.192	0,06	665	USD	GE Vernova	90.939	0,03
588	USD	Burlington Stores	136.528	0,04	7.185	USD	Golden Entertainment	264.624	0,08
922	USD	Cactus	46.183	0,01	1.858	USD	Goldman Sachs Group	776.068	0,24
824	USD	Capital One Financial	122.685	0,04	4.059	GBP	GSK	87.533	0,03
7.605	USD	Cargo Therapeutics	169.744	0,05	13.179	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	374.284	0,12
940	USD	Celldex Therapeutics	39.452	0,01			HCA Healthcare	594.684	0,19
4.700	USD	Celsius Holdings	389.724	0,12	1.783	USD	Health Catalyst	34.917	0,01
4.641	USD	Centene	364.226	0,11	4.637	USD	Humana	247.905	0,08
2.450	USD	CG oncology	107.555	0,03	715	USD	ICON	90.371	0,03
13.116	USD	Chesapeake Energy	1.165.094	0,37	269	USD	Insulet	88.614	0,03
12	USD	Chipotle Mexican Grill	34.881	0,01	517	USD	Intuitive Surgical	377.140	0,12
4.196	USD	Chord Energy	747.895	0,24	945	USD	Ionis Pharmaceuticals	249.566	0,08
193	USD	Citigroup	12.205	-	5.757	USD	JPMorgan Chase	771.956	0,24
16.948	USD	Comstock Resources	157.277	0,05	3.854	USD	KKR	2.907.064	0,92
8.062	USD	ConocoPhillips	1.026.131	0,32	28.903	USD	Kodiak Gas Services	69.990	0,02
15.459	USD	Coterra Energy	430.997	0,14	2.560	USD	Kymera Therapeutics	107.495	0,03
5.777	USD	Crinetics Pharmaceuticals	270.421	0,08	2.674	USD	Kyverna Therapeutics	53.282	0,02
7.447	USD	Cytokinetics	522.109	0,16	2.145	USD	Laboratory of America Holdings	20.754	0,01
750	USD	Danaher	187.290	0,06	95	USD	Legend Biotech	116.387	0,04
7.175	USD	Denali Therapeutics	147.231	0,05	2.075	USD	Liberty Media-Liberty Formula One	389.598	0,12
1.616	USD	Dexcom	224.139	0,07	5.939	USD	Live Nation Entertainment	607.649	0,19
4.829	USD	Diamond Offshore Drilling	65.868	0,02	5.745	USD	Longboard Pharmaceuticals	186.624	0,06
10.812	USD	Diamondback Energy	2.142.614	0,68	8.640	USD	Lululemon Athletica	73.052	0,02
930	USD	Disc Medicine	57.902	0,02	187	USD	Maplebear	13.797	-
8.763	USD	Dominion Energy	431.052	0,14	370	USD			
1.746	USD	DoubleVerify Holdings	61.389	0,02					
5.757	USD	DraftKings	261.425	0,08					

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
304.594.700	MXN	Mexico Cetes 24/12/25, ZCP	1.531.118	0,48
Peru			1.277.360	0,40
4.725.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/31, 6,95 %	1.277.360	0,40
Südafrika			1.706.609	0,54
43.745.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8,50 %	1.706.609	0,54
Supranational			1.322.156	0,42
127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.100.680	0,35
13.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	173.286	0,05
3.800.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	48.190	0,02
USA			204.539	0,06
287.000	USD	Williams 15/10/51, 3,50 %	204.539	0,06
Summe Anleihen			6.211.493	1,95
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			117.158.293	36,81

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
Anleihen				
Japan			9.373.782	2,95
1.418.950.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 01/07/24, ZCP	9.373.782	2,95
Vereinigtes Königreich			540.601	0,17
517.000	USD	Immunocore Holdings 01/02/30, 2,50 %	540.601	0,17
USA			142.771.675	44,86
1.308.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5,25 %	1.266.261	0,41
1.330.000	USD	Citigroup perpetual, variabel	1.278.542	0,41
255.000	USD	Diamond Foreign Asset 01/10/30, 8,50 %	269.274	0,08
1.115.000	USD	Energy Transfer 15/03/25, 4,05 %	1.170.596	0,38
626.000	USD	Five9 15/03/29, 1,00 %	649.475	0,20
1.280.000	USD	Frontier Communications Holdings 15/05/30, 8,75 %	1.310.588	0,42
755.000	USD	Liberty Mutual Group 15/12/51, variable	683.313	0,21

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- ver- mögen
510.000	USD	NextEra Energy Capital Holdings 01/03/27, 3,00 %	546.465	0,17
952.000	USD	Rexford Industrial Realty 15/03/27, 4,38 %	964.485	0,30
952.000	USD	Rexford Industrial Realty 15/03/29, 4,13 %	964.353	0,30
56.000	USD	Sunnova Energy 01/09/26, 5,88 %	43.803	0,01
141.000	USD	Sunnova Energy International 15/02/28, 2,63 %	57.450	0,02
88.000	USD	Sunrun 01/02/26, ZCP	75.328	0,02
72.000	USD	Sunrun 01/03/30, 4,00 %	71.981	0,02
400.000	USD	Tidewater 03/07/28, 10,38 %	428.000	0,13
13.215.000	USD	United States Treasury Bill 02/04/24, ZCP	13.207.265	4,15
10.450.000	USD	United States Treasury Bill 04/04/24, ZCP	10.440.804	3,28
19.735.000	USD	United States Treasury Bill 09/04/24, ZCP	19.703.217	6,19
14.740.000	USD	United States Treasury Bill 16/04/24, ZCP	14.701.110	4,62
3.235.000	USD	United States Treasury Bill 18/04/24, ZCP	3.225.606	1,01
6.190.000	USD	United States Treasury Bill 23/04/24, ZCP	6.167.091	1,94
3.685.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	3.670.576	1,15
9.770.000	USD	United States Treasury Bill 30/04/24, ZCP	9.724.141	3,06
2.330.000	USD	United States Treasury Bill 02/05/24, ZCP	2.318.439	0,73
9.795.000	USD	United States Treasury Bill 07/05/24, ZCP	9.739.049	3,06
5.130.000	USD	United States Treasury Bill 09/05/24, ZCP	5.099.233	1,60
5.370.000	USD	United States Treasury Bill 14/05/24, ZCP	5.333.840	1,68
2.445.000	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	2.427.950	0,76
15.345.000	USD	United States Treasury Bill 21/05/24, ZCP	15.226.015	4,78
5.405.000	USD	United States Treasury Bill 28/05/24, ZCP	5.357.870	1,68
1.655.000	USD	United States Treasury Bill 30/05/24, ZCP	1.640.740	0,52
2.455.000	USD	United States Treasury Bill 06/06/24, ZCP	2.430.344	0,76
2.610.000	USD	United States Treasury Bill 20/06/24, ZCP	2.578.471	0,81
Summe Anleihen			152.686.058	47,98
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			152.686.058	47,98

Die Anmerkungen auf den Seiten 60 bis 140 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- ver- mögens
Anleihen				
Schweiz				
1.867.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7,25 %	-	-
200.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50 %	-	-
325.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50 %	-	-
Summe Anleihen			-	-
Summe sonstige Wertpapiere			-	-
Summe Kapitalanlagen			269.844.351	84,79
Sonstiges Nettovermögen			48.395.646	15,21
Nettoinventarwert			318.239.997	100,00

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024

Die Gesellschaft

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

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

Anteilsklassen

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

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

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

Ausgabeaufschlag

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

Anteilsklassen	Ausgabeaufschlag
A ¹ -, A2- und K-Anteile	Bis zu 3 % des Nettoinventarwerts je Anteil
A1-Anteile	Bis zu 2 % des Nettoinventarwerts je Anteil
C-, C1-, E ² - und F-Anteile	Bis zu 1 % des Nettoinventarwerts je Anteil
I-, IF-, IZ-, N-, PI-, R-, R1-, R2-, R3-, R4-, R5-, S-, X-, Y-, Y1-, Y2- und Y3-Anteile	Kein Ausgabeaufschlag

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

² Für Anteile der Klasse E des Schroder GAIA Asian Equity Long Short fällt kein Ausgabeaufschlag an.

Vertriebsgebühr

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

Swing-Pricing

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

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

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

Am 28. März 2024, dem letzten Berechnungstag des Berichtszeitraums, wurden für keinen der Teilfonds Swing-Pricing-Anpassungen vorgenommen.

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilsklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeichnungen		Mindestanlagebestand	
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	A-, 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
	IZ- und X1*-Anteile	USD	100.000.000	USD	20.000.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA BlueTrend	A-, C-, E- und N-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

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

Teilfonds	Anteilsklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeichnungen		Mindestanlagebestand	
Schroder GAIA Cat Bond	A-, C-, F- und PI-Anteile	USD	100.000	USD	50.000	USD	100.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	IF-Anteile	USD	1.000.000	USD	500.000	USD	1.000.000
	Y-, Y1-, Y2- und Y3*-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
Schroder GAIA Egerton Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR	10.000	EUR	5.000	EUR	10.000
	X-Anteile	EUR	100.000.000	EUR	2.500.000	EUR	100.000.000
Schroder GAIA Helix	A-, C-, C1-, E- und S-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	IZ-Anteile	USD	100.000.000	USD	20.000.000	USD	100.000.000
	X-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA SEG US Equity	C-, K- und R4-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	IZ-Anteile	USD	100.000.000	USD	20.000.000	USD	100.000.000
	R1-Anteile	USD	10.000	USD	5.000		Entfällt
	R2- und R5-Anteile	USD	10.000.000		Entfällt	USD	10.000.000
	R3-Anteile	USD	500.000		Entfällt		Entfällt
Schroder GAIA Sirius US Equity	A-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	X-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C- und K-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

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

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

Der Abschluss wird auf der Grundlage des letzten während des Berichtszeitraums berechneten NIW (28. März 2024 für alle Teilfonds) erstellt und in Übereinstimmung mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds dargestellt.

Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

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

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

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

Der Gesamtabchluss wird in EUR, der Währung der Gesellschaft, aufgestellt, und die Abschlüsse der Teilfonds werden in der jeweiligen Basiswährung aufgestellt. Für die Umrechnung von anderen Währungen als dem EUR in der Nettovermögensaufstellung, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in EUR werden die zum Ende des Berichtszeitraums geltenden Wechselkurse verwendet.

Fair Value Pricing

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

Zum 31. März 2024 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
S Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP
	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
S Schroder GAIA Helix	CFD auf TRINITY LIMITED
S Schroder GAIA Wellington Pagosa	TRS auf OMNIAB INC. CEDE EARN OUT
	TRS auf OMNIAB INC CEDE EARN OUT 15
	Clementia Pharmaceuticals
	Credit Suisse Group perpetual, 7,25 %
	Credit Suisse Group perpetual, 7,50 %
	Credit Suisse Group perpetual *, 7,50 %

Besteuerung

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

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

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

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

Managementgebühren

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

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
S Schroder GAIA Asian Equity Long Short	A-Anteile	2,00 %
	C- und IZ-Anteile	1,00 %
	E*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,75 %)
	X1*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,85 %)
	I-Anteile	Entfällt
S Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60 %
	C-, E- und N-Anteile	1,00 %
S Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50 %
	C- und IF-Anteile	1,10 %
	PI-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10 % (0,46 %)
	Y-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10 % (0,88 %)
	Y1-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,50 % (1,28 %)
	Y2-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10 % (0,24 %)
	Y3*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,50 % (0,75 %)
	I-Anteile	Entfällt
S Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Managementgebühren (Forts.)

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und E-Anteile	1,25 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
Schroder GAIA Helix	A-Anteile	2,00 %
	C-, C1- und IZ-Anteile	1,00 %
	E-Anteile	0,75 %
	S-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,35 %)
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,60 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-Anteile	1,25 %
	C-Anteile	0,75 %
	E-Anteile	0,60 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA SEG US Equity	C- und R3-Anteile	1,40 %
	IZ-, R2- und R5-Anteile	1,15 %
	K-Anteile	1,90 %
	R1-Anteile	1,75 %
	R4-Anteile	2,30 %
Schroder GAIA 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 %)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	0,75 %

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

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 12.750 EUR. Bernard Herman erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von EUR 12.250. Eric Bertrand erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 13.250 EUR. Hugh Mullan erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 11.000 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

Performancegebühren

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

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

Nähere Einzelheiten zu den Mechanismen der Performancegebühr für den Berichtszeitraum sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für den Berichtszeitraum zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Fällige Performancegebühren“ ausgewiesen. Die für die einzelnen Anteilsklassen während des Berichtszeitraums in Rechnung gestellten Performancegebühren sind auf den Seiten 139-140 aufgeführt.

Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short, in GBP abgesichert*	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA BlueTrend	Systematica Investments Limited	

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Performancegebühren (Forts.)

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

Für Schroder GAIA Asian Equity Long Short, Schroder GAIA Contour Tech Equity, Schroder GAIA Egerton Equity, Schroder GAIA SEG US Equity und Schroder GAIA Two Sigma Diversified beträgt die Performancegebühr 20 % der Outperformance.

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

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

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

Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

Die Verwahrstelle 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 Teilfonds zu zahlen sind.

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte

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

Am 31. März 2024 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short					
Absicherung des Portfolios					
AUD	5.489.000	USD	3.666.735	17. Apr. 2024	(88.307)
GBP	988.000	USD	1.260.233	17. Apr. 2024	(13.128)
NZD	54.000	USD	33.648	17. Apr. 2024	(1.385)
SGD	1.847.000	USD	1.391.530	17. Apr. 2024	(22.683)
					USD (125.503)
Absicherung der Anteilsklasse					
GBP	4.790.825	USD	6.119.278	30. Apr. 2024	(71.615)
USD	13.960	GBP	10.930	30. Apr. 2024	162
					USD (71.453)
					USD (196.956)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	1.200.000	USD	781.867	03. Apr. 2024	136
AUD	21.400.000	USD	14.120.616	17. Apr. 2024	(169.376)
AUD	775.000	USD	505.902	24. Apr. 2024	(556)
BRL	1.121.800	USD	225.858	24. Apr. 2024	(2.686)
BRL	1.121.800	USD	222.156	28. Mai 2024	327
BRL	149.747.429	USD	29.829.009	20. Jun. 2024	(196.665)
CAD	35.548.341	USD	26.345.752	17. Apr. 2024	(96.362)
CHF	775.856	USD	856.606	02. Apr. 2024	3.688
CHF	291.331	USD	321.733	03. Apr. 2024	1.339
CHF	691.020	USD	775.526	17. Apr. 2024	(8.031)
CHF	820.000	USD	916.420	24. Apr. 2024	(4.961)
CLP	10.673.009.296	USD	11.213.013	21. Jun. 2024	(342.009)
CNH	8.588.720	USD	1.183.898	02. Apr. 2024	(1.254)
CNH	11.136.753	USD	1.534.749	03. Apr. 2024	(1.239)
CNH	112.649.751	USD	15.627.494	17. Apr. 2024	(109.821)
EUR	600.000	USD	648.371	03. Apr. 2024	(1.036)
EUR	15.900.000	USD	17.365.762	17. Apr. 2024	(201.827)
EUR	800.000	USD	869.282	24. Apr. 2024	(5.444)
GBP	500.000	USD	631.230	02. Apr. 2024	(155)
GBP	1.100.000	USD	1.389.844	03. Apr. 2024	(1.472)
GBP	15.448.519	USD	19.775.598	17. Apr. 2024	(275.654)
HUF	685.689	USD	1.876	02. Apr. 2024	3
HUF	3.662.153.690	USD	10.018.804	17. Apr. 2024	3.214
IDR	140.522.246.581	USD	8.975.737	20. Jun. 2024	(131.898)
ILS	19.926.203	USD	5.529.640	17. Apr. 2024	(107.274)
INR	2.899.987.854	USD	34.831.244	20. Jun. 2024	(144.262)
JPY	384.041.701	USD	2.595.979	17. Apr. 2024	(53.232)
JPY	141.595.000	USD	937.689	24. Apr. 2024	816
KRW	36.152.706.216	USD	27.521.578	20. Jun. 2024	(550.400)
MXN	8.513.506	USD	510.649	01. Apr. 2024	1.457
MXN	22.540.889	USD	1.363.244	02. Apr. 2024	(7.361)
MXN	883.075.004	USD	51.972.696	17. Apr. 2024	1.022.841
NOK	19.224.597	USD	1.783.276	02. Apr. 2024	(12.484)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
NOK	89.759.945	USD	8.624.794	17. Apr. 2024	(353.744)
NZD	600.000	USD	360.066	02. Apr. 2024	(1.596)
NZD	25.700.000	USD	15.857.462	17. Apr. 2024	(502.768)
PHP	798.776.203	USD	14.373.353	20. Jun. 2024	(183.188)
PLN	191.003.462	USD	48.257.399	17. Apr. 2024	(444.233)
SEK	87.031.884	USD	8.518.407	17. Apr. 2024	(382.759)
SGD	35.730.229	USD	26.820.454	17. Apr. 2024	(340.104)
SGD	1.741.415	USD	1.303.962	15. Mai 2024	(11.669)
THB	339.551.470	USD	9.519.854	17. Apr. 2024	(202.369)
TWD	76.476.057	USD	2.435.804	20. Jun. 2024	(24.160)
USD	2.804.366	AUD	4.300.000	02. Apr. 2024	2.272
USD	2.665.980	AUD	4.100.000	03. Apr. 2024	(5.861)
USD	46.146.954	AUD	70.000.000	17. Apr. 2024	512.060
USD	3.499.220	AUD	5.350.000	24. Apr. 2024	10.698
USD	222.829	BRL	1.121.800	24. Apr. 2024	(343)
USD	4.133.760	BRL	20.954.076	20. Jun. 2024	(12.676)
USD	45.771.531	CAD	61.904.279	17. Apr. 2024	60.549
USD	3.755.339	CAD	5.100.000	24. Apr. 2024	(10.959)
USD	900.000	CHF	815.349	02. Apr. 2024	(4.085)
USD	1.200.000	CHF	1.082.443	03. Apr. 2024	(378)
USD	42.684.797	CHF	37.669.069	17. Apr. 2024	846.822
USD	308.366	CHF	275.000	24. Apr. 2024	2.693
USD	36.756.374	CLP	35.824.000.178	21. Jun. 2024	267.796
USD	1.183.746	CNH	8.588.720	02. Apr. 2024	1.100
USD	1.536.018	CNH	11.136.751	03. Apr. 2024	2.507
USD	52.761.947	CNH	379.274.098	17. Apr. 2024	516.358
USD	9.437.943	CNH	68.125.244	16. Mai 2024	40.635
USD	9.861	CZK	230.000	24. Apr. 2024	57
USD	3.247.566	EUR	3.000.000	02. Apr. 2024	11.016
USD	4.647.663	EUR	4.300.000	03. Apr. 2024	8.430
USD	31.260.204	EUR	28.800.000	17. Apr. 2024	170.813
USD	11.758.318	EUR	10.835.000	24. Apr. 2024	58.706
USD	2.901.493	GBP	2.300.000	02. Apr. 2024	(1.448)
USD	1.893.715	GBP	1.500.000	03. Apr. 2024	477
USD	23.949.927	GBP	18.948.519	17. Apr. 2024	32.096
USD	1.100.318	GBP	870.000	24. Apr. 2024	2.116
USD	1.026.692	HKD	8.025.000	24. Apr. 2024	631
USD	110.832	HUF	40.449.944	02. Apr. 2024	16
USD	306.250	HUF	111.800.640	03. Apr. 2024	(14)
USD	5.131.262	HUF	1.870.031.529	17. Apr. 2024	13.646
USD	5.802	HUF	2.125.000	24. Apr. 2024	(10)
USD	25.684.407	IDR	404.371.373.818	20. Jun. 2024	235.093
USD	10.077.180	ILS	36.852.128	17. Apr. 2024	48.886
USD	20.034.905	INR	1.672.237.574	20. Jun. 2024	33.140
USD	55.955.424	JPY	8.307.228.186	17. Apr. 2024	953.122
USD	2.235.504	JPY	336.560.000	24. Apr. 2024	4.754
USD	2.482.812	KRW	3.315.944.977	24. Apr. 2024	16.702
USD	54.061.362	KRW	71.613.280.034	20. Jun. 2024	635.358
USD	510.201	MXN	8.513.507	01. Apr. 2024	(1.905)
USD	1.360.515	MXN	22.540.890	02. Apr. 2024	4.631

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	8.345.195	MXN	139.474.350	17. Apr. 2024	(25.009)
USD	1.793.976	NOK	19.224.596	02. Apr. 2024	23.186
USD	4.738.035	NOK	51.208.877	03. Apr. 2024	21.024
USD	37.139.220	NOK	393.726.483	17. Apr. 2024	858.757
USD	2.218.086	NZD	3.700.000	02. Apr. 2024	7.522
USD	2.335.309	NZD	3.900.000	03. Apr. 2024	5.256
USD	51.684.450	NZD	85.000.000	17. Apr. 2024	900.433
USD	27.018	NZD	45.000	24. Apr. 2024	132
USD	11.092.636	PHP	624.310.192	20. Jun. 2024	1.838
USD	11.720.042	PLN	46.657.159	17. Apr. 2024	40.535
USD	30.340	PLN	120.000	24. Apr. 2024	302
USD	2.039.554	SEK	21.623.252	02. Apr. 2024	19.445
USD	1.607.269	SEK	17.148.193	03. Apr. 2024	5.172
USD	38.626.966	SEK	404.433.501	17. Apr. 2024	820.944
USD	499.394	SEK	5.275.000	24. Apr. 2024	6.154
USD	31.756.604	SGD	42.571.761	17. Apr. 2024	205.864
USD	186.225	SGD	250.000	24. Apr. 2024	885
USD	33.359.639	SGD	44.838.023	15. Mai 2024	85.632
USD	36.380.562	THB	1.299.198.977	17. Apr. 2024	729.805
USD	483.724	THB	17.401.151	24. Apr. 2024	5.967
USD	2.913.131	THB	105.038.768	15. Mai 2024	24.055
USD	718.060	TRY	23.890.000	24. Apr. 2024	(1.023)
USD	39.985.985	TWD	1.249.391.614	20. Jun. 2024	586.882
USD	396.877	ZAR	7.508.678	02. Apr. 2024	430
USD	1.301.239	ZAR	24.779.845	03. Apr. 2024	(6.998)
USD	14.540.576	ZAR	276.145.137	17. Apr. 2024	(22.197)
USD	887.251	ZAR	16.825.000	24. Apr. 2024	471
ZAR	274.280.146	USD	14.637.430	17. Apr. 2024	(173.008)
					USD 4.739.729
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	172.541.161	USD	34.572.326	30. Apr. 2024	(267.207)
CHF	1.589.231	USD	1.783.920	30. Apr. 2024	(16.251)
EUR	87.515.291	USD	95.625.405	30. Apr. 2024	(1.103.691)
GBP	122.750.355	USD	156.761.037	30. Apr. 2024	(1.808.042)
SEK	39.387.043	USD	3.795.550	30. Apr. 2024	(111.770)
USD	2.490.000	BRL	12.428.262	30. Apr. 2024	18.978
USD	27.304	CHF	24.622	30. Apr. 2024	(82)
USD	15.140	EUR	13.967	30. Apr. 2024	56
USD	84.931	GBP	67.209	30. Apr. 2024	89
USD	8.814	SEK	92.178	30. Apr. 2024	193
					USD (3.287.727)
					USD 1.452.002
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	96.236.833	EUR	88.634.000	24. Mai 2024	413.599
USD	6.516.804	NZD	10.544.000	24. Mai 2024	216.891
					USD 630.490
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	292.156.179	USD	327.980.196	30. Apr. 2024	(3.021.013)
EUR	925.232.667	USD	1.011.002.293	30. Apr. 2024	(11.696.050)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)					
GBP	38.715.324	USD	49.450.320	30. Apr. 2024	(578.317)
JPY	1.393.094	USD	9.322	29. Mrz. 2024	(120)
JPY	1.401.699	USD	9.294	30. Apr. 2024	5
SEK	8.161.966.744	USD	786.640.333	30. Apr. 2024	(23.270.244)
SGD	670.346	USD	501.035	30. Apr. 2024	(3.928)
USD	588.993	CHF	526.796	30. Apr. 2024	3.048
USD	1.962	EUR	1.813	30. Apr. 2024	3
USD	153.477	GBP	121.862	30. Apr. 2024	(355)
USD	9.192	JPY	1.393.094	29. Mrz. 2024	(10)
USD	14.030	SEK	148.129	30. Apr. 2024	176
					USD (38.566.805)
					USD (37.936.315)
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	2.070.794	USD	1.358.302	10. Mai 2024	(7.385)
EUR	1.945.915	USD	2.112.773	10. Mai 2024	(10.216)
GBP	2.699.968	USD	3.420.140	10. Mai 2024	(11.661)
JPY	319.699.855	USD	2.148.317	10. Mai 2024	(23.890)
NOK	23.077.842	USD	2.191.807	10. Mai 2024	(64.046)
USD	1.207.699	AUD	1.843.577	10. Mai 2024	5.013
USD	2.750.967	EUR	2.532.153	10. Mai 2024	14.980
USD	1.006	GBP	796	03. Apr. 2024	1
USD	2.849.585	GBP	2.253.812	10. Mai 2024	4.341
USD	2.024.609	JPY	298.455.655	10. Mai 2024	41.350
USD	2.214.172	NOK	23.433.571	10. Mai 2024	53.612
USD	9.419	SEK	100.000	03. Apr. 2024	76
					USD 2.175
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.978.874	USD	3.343.857	30. Apr. 2024	(30.519)
EUR	45.220.930	USD	49.411.361	30. Apr. 2024	(570.067)
GBP	24.309.953	USD	31.045.183	30. Apr. 2024	(357.696)
SEK	72.054.875	USD	6.943.372	30. Apr. 2024	(204.245)
SGD	827.298	USD	618.959	30. Apr. 2024	(5.463)
USD	20.322	CHF	18.065	30. Apr. 2024	230
USD	430.635	EUR	396.417	30. Apr. 2024	2.479
USD	32.633	GBP	25.842	30. Apr. 2024	12
USD	53.941	SEK	565.216	30. Apr. 2024	1.079
					USD (1.164.190)
					USD (1.162.015)
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CNY	6.861.000	EUR	889.987	11. Apr. 2024	(9.582)
EUR	22.654.692	CAD	33.398.000	10. Apr. 2024	(194.937)
EUR	2.157.416	CHF	2.068.000	10. Apr. 2024	30.739
EUR	4.905.827	INR	442.432.000	12. Apr. 2024	(8.022)
EUR	2.620.181	MXN	48.676.000	10. Apr. 2024	(89.586)
EUR	2.681.136	SEK	30.146.000	10. Apr. 2024	70.629
EUR	298.232.504	USD	324.531.000	10. Apr. 2024	(2.485.536)
GBP	4.981.000	EUR	5.812.325	10. Apr. 2024	13.392

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)					
INR	222.340.000	EUR	2.459.404	12. Apr. 2024	10.004
KRW	3.101.872.000	EUR	2.145.718	11. Apr. 2024	(9.738)
					EUR (2.672.637)
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	244	GBP	209	30. Apr. 2024	-
EUR	6.873.432	USD	7.449.431	30. Apr. 2024	(23.807)
GBP	22.005.865	EUR	25.730.347	30. Apr. 2024	(10.512)
USD	231.571.835	EUR	211.935.161	30. Apr. 2024	2.471.294
					EUR 2.436.975
					EUR (235.662)
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	20.427.000	USD	13.668.448	17. Apr. 2024	(336.227)
AUD	24.450.246	USD	16.134.832	18. Apr. 2024	(176.275)
BRL	1.770.000	USD	355.050	02. Apr. 2024	(1.442)
CAD	1.350.869	USD	1.002.296	18. Apr. 2024	(3.823)
CHF	774.000	EUR	823.938	18. Apr. 2024	(29.567)
CHF	11.857.555	USD	13.768.157	18. Apr. 2024	(580.034)
CLP	527.285.000	USD	547.736	03. Jun. 2024	(11.103)
COP	765.000.000	USD	195.611	29. Apr. 2024	1.383
DKK	50.121.116	USD	7.340.083	18. Apr. 2024	(77.220)
EUR	83.033	CHF	78.000	18. Apr. 2024	2.980
EUR	34.798.234	USD	37.999.514	18. Apr. 2024	(393.504)
GBP	38.000	EUR	44.150	18. Apr. 2024	295
GBP	3.498.000	USD	4.461.583	17. Apr. 2024	(42.372)
GBP	20.346.729	USD	25.820.618	18. Apr. 2024	(115.341)
HKD	340.922.179	USD	43.676.444	18. Apr. 2024	(92.660)
INR	767.438.527	USD	9.197.820	18. Apr. 2024	(115)
JPY	5.284.645.765	USD	36.071.852	18. Apr. 2024	(1.068.770)
NGN	259.000.000	USD	181.119	27. Jun. 2024	13.555
NOK	452.000	EUR	39.458	18. Apr. 2024	(960)
NOK	13.514.195	USD	1.286.593	18. Apr. 2024	(40.374)
NZD	282.000	USD	175.719	17. Apr. 2024	(7.038)
NZD	247.424	USD	151.077	18. Apr. 2024	(3.079)
SEK	14.482.420	USD	1.393.132	18. Apr. 2024	(37.828)
SGD	6.793.000	USD	5.121.799	17. Apr. 2024	(84.936)
SGD	7.065.060	USD	5.288.542	18. Apr. 2024	(49.713)
USD	1.073.121	AUD	1.626.520	18. Apr. 2024	11.500
USD	356.559	BRL	1.770.000	02. Apr. 2024	2.951
USD	3.137.829	BRL	15.566.489	18. Apr. 2024	33.096
USD	176.091	BRL	890.000	03. Mai 2024	(1.165)
USD	352.990	BRL	1.770.000	04. Jun. 2024	1.471
USD	601.350	CAD	812.336	18. Apr. 2024	925
USD	1.708.533	CHF	1.479.551	18. Apr. 2024	62.957
USD	710.444	COP	2.846.795.000	29. Apr. 2024	(22.629)
USD	1.381.718	DKK	9.434.031	18. Apr. 2024	14.667
USD	8.076.059	EUR	7.412.916	18. Apr. 2024	65.015
USD	887.609	EUR	825.000	15. Mai 2024	(4.945)
USD	595.190	GBP	470.000	17. Apr. 2024	1.413

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
USD	15.443.958	GBP	12.167.784	18. Apr. 2024	71.645
USD	7.256.583	HKD	56.694.204	18. Apr. 2024	8.749
USD	5.992.316	JPY	880.124.660	18. Apr. 2024	162.771
USD	176.382	MXN	3.080.000	07. Mai 2024	(7.903)
USD	304.044	NOK	3.208.765	18. Apr. 2024	8.145
USD	152.785	NZD	247.400	18. Apr. 2024	4.800
USD	195.384	SEK	2.047.451	18. Apr. 2024	3.776
USD	135.796	SGD	182.500	18. Apr. 2024	470
					USD (2.716.459)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	835.469	USD	937.917	30. Apr. 2024	(7.457)
EUR	181.024.781	USD	197.821.914	30. Apr. 2024	(2.095.750)
GBP	26.442.998	USD	33.773.497	30. Apr. 2024	(364.233)
JPY	1.211.173	USD	8.105	29. Mrz. 2024	(102)
JPY	1.214.407	USD	8.052	30. Apr. 2024	6
SEK	72.810	USD	7.017	30. Apr. 2024	(199)
SGD	30.329	USD	22.694	30. Apr. 2024	(191)
USD	125.149	EUR	115.190	30. Apr. 2024	603
USD	210.399	GBP	166.591	30. Apr. 2024	(81)
USD	7.992	JPY	1.211.173	29. Mrz. 2024	(11)
					USD (2.467.415)
					USD (5.183.874)
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	73.329	USD	47.899	18. Apr. 2024	(93)
EUR	1.429	USD	1.547	03. Apr. 2024	(5)
EUR	2.795.823	USD	3.030.779	18. Apr. 2024	(12.588)
GBP	524.195	USD	664.155	18. Apr. 2024	(2.483)
USD	1.019.062	AUD	1.519.689	18. Apr. 2024	28.307
USD	22.868.028	EUR	20.828.915	18. Apr. 2024	382.467
USD	3.347.172	GBP	2.629.374	18. Apr. 2024	28.221
USD	65.731	JPY	9.800.000	18. Apr. 2024	835
					USD 424.661
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	133.995	USD	150.428	30. Apr. 2024	(1.387)
EUR	13.896.931	USD	15.186.289	30. Apr. 2024	(176.780)
GBP	1.884.144	USD	2.406.596	30. Apr. 2024	(28.162)
USD	65.739	EUR	60.759	30. Apr. 2024	115
USD	21	GBP	16	30. Apr. 2024	-
					USD (206.214)
					USD 218.447
Schroder GAIA SEG US Equity					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.392.414	USD	2.685.426	30. Apr. 2024	(24.395)
EUR	175.892.396	USD	192.185.961	30. Apr. 2024	(2.211.725)
GBP	14.047.347	USD	17.938.330	30. Apr. 2024	(205.769)
USD	5.718	CHF	5.083	30. Apr. 2024	65
USD	764.962	EUR	703.609	30. Apr. 2024	5.025
USD	86.966	GBP	68.816	30. Apr. 2024	98
					USD (2.436.701)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CAD	1.996.000	USD	1.475.439	20. Jun. 2024	(188)
DKK	4.975.000	USD	729.741	20. Jun. 2024	(7.237)
EUR	141.000	USD	153.170	20. Jun. 2024	(559)
GBP	2.132.000	USD	2.695.944	20. Jun. 2024	(3.906)
USD	188.439	CHF	165.000	20. Jun. 2024	3.852
USD	11.846.254	EUR	10.832.000	20. Jun. 2024	122.244
USD	17.881.157	GBP	14.038.000	20. Jun. 2024	155.627
					USD 269.833
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	3.190.358	USD	3.581.581	30. Apr. 2024	(33.012)
EUR	24.146.973	USD	26.387.574	30. Apr. 2024	(307.410)
GBP	4.091.688	USD	5.226.273	30. Apr. 2024	(61.161)
USD	794.225	CHF	715.271	30. Apr. 2024	(1.357)
USD	901.771	EUR	832.050	30. Apr. 2024	3.107
					USD (399.833)
					USD (130.000)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	12.871.001	USD	8.416.617	20. Jun. 2024	(10.395)
CAD	4.078.721	USD	3.008.063	20. Jun. 2024	6.535
CHF	10.619.004	USD	12.148.166	20. Jun. 2024	(268.595)
CNH	6.699.280	USD	935.285	20. Jun. 2024	(9.400)
EUR	12.981.548	USD	14.165.300	20. Jun. 2024	(114.729)
GBP	26.390.975	USD	33.587.532	20. Jun. 2024	(264.121)
ILS	532.724	USD	148.304	20. Jun. 2024	(2.922)
JPY	1.478.813.088	USD	10.102.830	20. Jun. 2024	(213.326)
KRW	389.557.200	USD	292.000	20. Jun. 2024	(1.377)
MXN	79.886.979	USD	4.637.571	20. Jun. 2024	107.512
NOK	13.392.484	USD	1.271.205	20. Jun. 2024	(35.264)
NZD	12.220.920	USD	7.447.881	20. Jun. 2024	(146.117)
PLN	22.487.660	USD	5.660.041	20. Jun. 2024	(34.885)
SEK	13.828.772	USD	1.338.127	20. Jun. 2024	(41.917)
SGD	9.159.730	USD	6.860.498	20. Jun. 2024	(52.047)
TWD	10.101.747	USD	318.000	20. Jun. 2024	555
USD	3.167.985	AUD	4.846.186	20. Jun. 2024	2.877
USD	11.817.840	CAD	16.023.064	20. Jun. 2024	(24.867)
USD	10.671.683	CHF	9.332.302	20. Jun. 2024	231.558
USD	15.358.636	CNH	110.027.020	20. Jun. 2024	152.180
USD	1.580.378	CZK	36.861.741	20. Jun. 2024	8.564
USD	34.926.052	EUR	31.981.548	20. Jun. 2024	310.839
USD	8.006.104	GBP	6.293.167	20. Jun. 2024	59.835
USD	653.054	HUF	239.934.747	20. Jun. 2024	(1.309)
USD	531.260	ILS	1.908.000	20. Jun. 2024	10.560
USD	20.236.478	JPY	2.978.813.038	20. Jun. 2024	315.786
USD	1.567.873	KRW	2.082.516.016	20. Jun. 2024	14.244
USD	8.494.422	MXN	146.344.058	20. Jun. 2024	(198.043)
USD	2.262.308	NOK	23.824.536	20. Jun. 2024	63.633
USD	1.657.297	NZD	2.718.759	20. Jun. 2024	32.891
USD	4.133.119	PLN	16.415.680	20. Jun. 2024	26.833

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)					
USD	1.712.663	SEK	17.694.924	20. Jun. 2024	54.068
USD	1.631.615	SGD	2.178.413	20. Jun. 2024	12.394
USD	70.689	THB	2.577.600	04. Apr. 2024	33
USD	395.502	TWD	12.397.011	20. Jun. 2024	4.567
USD	1.257.266	ZAR	23.953.911	20. Jun. 2024	867
ZAR	27.635.984	USD	1.450.440	20. Jun. 2024	(913)
					USD (3.896)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.720.056	USD	3.053.492	30. Apr. 2024	(28.030)
EUR	72.329.030	USD	79.039.121	30. Apr. 2024	(919.472)
GBP	60.034.389	USD	76.678.332	30. Apr. 2024	(894.368)
USD	3.031	EUR	2.771	30. Apr. 2024	38
USD	6.271.977	GBP	4.963.233	30. Apr. 2024	6.676
					USD (1.835.156)
					USD (1.839.052)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
AUD	72.000	JPY	7.125.166	03. Apr. 2024	(155)
AUD	16.737.000	USD	10.934.072	03. Apr. 2024	(27.108)
AUD	1.321.000	USD	844.119	19. Apr. 2024	17.127
AUD	3.694.859	USD	2.411.149	08. Mai 2024	(891)
AUD	2.985.000	USD	1.978.357	20. Jun. 2024	(28.813)
BRL	19.298.000	USD	3.890.910	02. Apr. 2024	(43.161)
BRL	3.506.000	USD	685.837	03. Apr. 2024	13.135
BRL	2.588.000	USD	519.157	08. Apr. 2024	(3.477)
BRL	13.533.000	USD	2.704.809	03. Mai 2024	(14.911)
BRL	13.726.000	USD	2.739.078	04. Jun. 2024	(18.613)
CAD	17.977.000	USD	13.263.556	03. Apr. 2024	8.204
CAD	3.992.000	USD	2.939.585	08. Mai 2024	9.074
CAD	286.000	USD	212.299	20. Jun. 2024	(916)
CHF	4.502.000	USD	5.049.096	03. Apr. 2024	(56.586)
CHF	784.000	USD	868.806	08. Mai 2024	4.011
CLP	5.448.173.000	USD	5.564.989	03. Apr. 2024	(4.470)
CLP	23.900.000	USD	24.378	08. Mai 2024	(12)
CLP	593.811.000	USD	608.418	21. Jun. 2024	(3.591)
CNH	109.935.000	USD	15.243.014	03. Apr. 2024	(105.168)
CNH	3.747.000	USD	523.939	20. Jun. 2024	(6.079)
COP	20.375.177.000	USD	5.162.371	03. Apr. 2024	107.915
COP	15.840.477.000	USD	4.094.099	08. Mai 2024	(21.264)
COP	2.599.194.000	USD	655.927	20. Jun. 2024	7.684
COP	1.178.351.000	USD	290.592	11. Jul. 2024	9.284
COP	12.039.800.000	USD	2.793.782	14. Aug. 2024	253.877
COP	11.967.700.000	USD	2.726.400	16. Aug. 2024	302.057
CZK	78.075.000	USD	3.336.611	03. Apr. 2024	(7.799)
CZK	19.977.000	USD	851.716	18. Apr. 2024	(74)
CZK	75.905.000	USD	3.250.903	09. Mai 2024	(15.177)
CZK	18.250.000	USD	786.556	20. Jun. 2024	(8.361)
DKK	4.890.000	USD	710.307	30. Apr. 2024	(2.041)
EGP	11.890.000	USD	222.035	06. Aug. 2024	20.188
EGP	11.890.000	USD	228.654	08. Aug. 2024	13.407

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
EUR	39.310.000	USD	42.702.577	03. Apr. 2024	(291.334)
EUR	6.459.000	USD	7.007.616	30. Apr. 2024	(31.513)
EUR	5.892.000	USD	6.383.545	08. Mai 2024	(17.772)
EUR	441.000	USD	475.067	14. Mai 2024	1.509
EUR	3.025.000	USD	3.308.544	20. Jun. 2024	(34.438)
GBP	20.534.000	USD	26.085.607	03. Apr. 2024	(168.491)
GBP	4.969.000	USD	6.276.150	08. Mai 2024	(3.286)
GBP	193.000	USD	243.663	31. Mai 2024	13
GBP	456.000	USD	585.652	20. Jun. 2024	(9.869)
HKD	255.000	USD	32.642	30. Apr. 2024	(32)
HUF	4.797.730.000	USD	13.194.933	03. Apr. 2024	(52.131)
HUF	341.230.000	USD	933.545	08. Mai 2024	(964)
HUF	820.615.000	USD	2.256.587	20. Jun. 2024	(18.562)
IDR	7.316.000.000	USD	471.726	03. Apr. 2024	(10.322)
IDR	65.000.000	USD	4.104	08. Mai 2024	(9)
IDR	4.876.000.000	USD	314.074	20. Jun. 2024	(7.201)
ILS	2.333.000	USD	582.300	29. Mrz. 2024	52.212
ILS	12.900.000	USD	3.525.351	03. Apr. 2024	(16.794)
ILS	85.000	USD	23.253	08. Mai 2024	(102)
INR	2.463.512.000	USD	29.599.137	03. Apr. 2024	(62.269)
INR	169.380.000	USD	2.030.911	08. Mai 2024	(2.056)
INR	203.576.000	USD	2.447.149	20. Jun. 2024	(12.162)
JPY	7.020.006	AUD	72.000	03. Apr. 2024	(540)
JPY	7.094.447	AUD	72.000	08. Mai 2024	160
JPY	2.240.690.000	USD	14.925.453	03. Apr. 2024	(121.439)
JPY	275.958.000	USD	1.836.212	08. Mai 2024	(3.065)
JPY	4.599.000	USD	31.260	18. Jun. 2024	(513)
JPY	52.800.000	USD	355.552	20. Jun. 2024	(2.454)
KRW	8.725.383.000	USD	6.500.572	03. Apr. 2024	(18.970)
KRW	1.432.780.000	USD	1.068.276	08. Mai 2024	(1.863)
KZT	241.700.000	USD	530.000	20. Jun. 2024	(712)
MXN	481.023.000	USD	28.614.134	03. Apr. 2024	315.976
MXN	137.710.000	USD	7.972.170	08. Apr. 2024	303.707
MXN	6.150.000	USD	330.983	11. Apr. 2024	38.438
MXN	109.273.000	USD	6.522.106	08. Mai 2024	13.649
MXN	4.798.000	USD	260.959	14. Mai 2024	25.719
MXN	9.706.000	USD	571.817	20. Jun. 2024	4.694
MXN	200.910.000	USD	11.054.195	28. Jun. 2024	865.209
MXN	98.570.000	USD	5.404.205	03. Jul. 2024	439.205
MXN	191.220.000	USD	10.552.693	08. Jul. 2024	774.155
MXN	77.010.000	USD	4.192.421	13. Sep. 2024	321.093
MXN	137.710.000	USD	7.197.512	07. Okt. 2024	843.255
MXN	145.870.000	USD	8.045.826	20. Dez. 2024	374.177
MXN	80.153.000	USD	4.490.742	10. Jan. 2025	121.665
MXN	47.355.000	USD	2.591.319	21. Jan. 2025	129.474
MXN	47.355.000	USD	2.595.292	29. Jan. 2025	122.417
MXN	107.000.000	USD	5.928.142	24. Feb. 2025	190.061
MXN	90.890.000	USD	5.147.096	20. Mrz. 2025	32.397
NOK	72.600.000	USD	6.857.241	03. Apr. 2024	(169.827)
NOK	27.893.000	USD	2.589.413	08. Mai 2024	(17.824)
NZD	23.250.000	USD	14.161.125	03. Apr. 2024	(270.413)
NZD	13.014.000	USD	7.803.421	08. Mai 2024	(27.848)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
NZD	165.000	USD	101.542	20. Jun. 2024	(2.957)
PEN	2.725.000	USD	719.877	03. Apr. 2024	12.690
PEN	2.990.000	USD	808.093	20. Jun. 2024	(5.459)
PHP	49.730.000	USD	893.902	03. Apr. 2024	(9.287)
PHP	28.570.000	USD	513.964	20. Jun. 2024	(6.422)
PLN	34.795.000	USD	8.741.505	03. Apr. 2024	(30.400)
PLN	20.824.000	USD	5.223.139	08. Mai 2024	(11.418)
PLN	7.275.000	USD	1.844.887	20. Jun. 2024	(25.087)
SEK	173.023.000	USD	16.518.947	03. Apr. 2024	(353.975)
SGD	7.444.000	USD	5.554.664	03. Apr. 2024	(41.358)
SGD	680.000	USD	513.023	20. Jun. 2024	(7.577)
THB	243.535.000	USD	6.780.198	03. Apr. 2024	(105.132)
THB	18.390.000	USD	508.714	20. Jun. 2024	(1.356)
TRY	5.305.000	USD	163.583	03. Apr. 2024	319
TRY	54.285.000	USD	1.505.926	20. Jun. 2024	23.017
TWD	173.320.000	USD	5.515.203	03. Apr. 2024	(98.615)
TWD	26.557.000	USD	833.553	08. Mai 2024	(191)
USD	10.948.512	AUD	16.737.000	03. Apr. 2024	41.545
USD	5.221	AUD	8.000	08. Mai 2024	2
USD	156.029	AUD	235.000	20. Jun. 2024	2.547
USD	3.872.214	BRL	19.298.000	02. Apr. 2024	24.465
USD	703.821	BRL	3.506.000	03. Apr. 2024	4.849
USD	312.085	BRL	1.552.000	08. Apr. 2024	2.837
USD	103.358	BRL	511.000	10. Apr. 2024	1.558
USD	309.986	BRL	1.550.000	03. Mai 2024	1.899
USD	1.769.918	BRL	8.856.000	04. Jun. 2024	14.676
USD	153.234	BRL	770.000	28. Jun. 2024	986
USD	328.926	BRL	1.642.000	11. Jul. 2024	4.675
USD	51.812	BRL	263.000	25. Jul. 2024	(52)
USD	13.268.195	CAD	17.977.000	03. Apr. 2024	(3.568)
USD	925.259	CAD	1.259.000	18. Apr. 2024	(4.418)
USD	1.569.716	CAD	2.125.000	08. Mai 2024	102
USD	10.057.717	CAD	13.540.000	20. Jun. 2024	50.253
USD	5.071.098	CHF	4.502.000	03. Apr. 2024	78.589
USD	439.842	CHF	397.000	08. Mai 2024	(2.133)
USD	221.138	CHF	192.000	20. Jun. 2024	6.346
USD	5.587.280	CLP	5.448.173.000	03. Apr. 2024	26.762
USD	5.428.730	CLP	5.322.273.000	08. Mai 2024	2.601
USD	914.460	CLP	877.900.000	21. Jun. 2024	20.273
USD	15.211.422	CNH	109.935.000	03. Apr. 2024	73.577
USD	7.928.972	CNH	57.368.000	08. Mai 2024	18.753
USD	1.029.218	CNH	7.404.000	20. Jun. 2024	5.937
USD	5.260.684	COP	20.375.177.000	03. Apr. 2024	(9.602)
USD	42.155	COP	163.100.000	08. Mai 2024	219
USD	2.747.558	COP	12.039.800.000	14. Aug. 2024	(300.100)
USD	2.857.617	COP	11.967.700.000	16. Aug. 2024	(170.841)
USD	3.344.700	CZK	78.075.000	03. Apr. 2024	15.887
USD	21.843	CZK	510.000	09. Mai 2024	102
USD	765.006	CZK	17.749.000	20. Jun. 2024	8.174
USD	1.035.683	DKK	7.130.000	30. Apr. 2024	2.976
USD	86.467	DKK	585.000	20. Jun. 2024	1.509
USD	250.580	EGP	11.890.000	06. Aug. 2024	8.357

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	234.748	EGP	11.890.000	08. Aug. 2024	(7.313)
USD	42.661.502	EUR	39.310.000	03. Apr. 2024	250.266
USD	16.915.284	EUR	15.591.000	30. Apr. 2024	76.078
USD	13.634.079	EUR	12.588.000	08. Mai 2024	33.884
USD	7.974.080	EUR	7.275.000	20. Jun. 2024	99.988
USD	26.086.485	GBP	20.534.000	03. Apr. 2024	169.374
USD	3.288.170	GBP	2.601.000	30. Apr. 2024	4.817
USD	3.653.240	GBP	2.893.000	08. Mai 2024	1.116
USD	1.117.369	GBP	875.000	20. Jun. 2024	12.522
USD	1.315.868	HKD	10.283.000	30. Apr. 2024	849
USD	371.948	HKD	2.901.000	20. Jun. 2024	451
USD	13.208.137	HUF	4.797.730.000	03. Apr. 2024	65.335
USD	857.006	HUF	322.320.000	18. Apr. 2024	(25.010)
USD	683.612	HUF	251.200.000	30. Apr. 2024	(3.231)
USD	8.218.223	HUF	2.998.500.000	08. Mai 2024	23.324
USD	1.452.206	HUF	530.400.000	20. Jun. 2024	5.671
USD	464.958	IDR	7.316.000.000	03. Apr. 2024	3.553
USD	545.763	IDR	8.583.000.000	20. Jun. 2024	5.587
USD	580.854	ILS	2.333.000	29. Mrz. 2024	(53.657)
USD	3.564.879	ILS	12.900.000	03. Apr. 2024	56.320
USD	2.096.870	ILS	7.665.000	08. Mai 2024	9.216
USD	29.573.428	INR	2.463.512.000	03. Apr. 2024	36.558
USD	414.338	INR	34.850.000	12. Apr. 2024	(3.405)
USD	15.348	INR	1.280.000	08. Mai 2024	16
USD	140.074	INR	11.748.000	13. Mai 2024	(623)
USD	886.931	INR	73.940.000	20. Jun. 2024	2.529
USD	115.675	INR	9.660.000	06. Sep. 2024	497
USD	15.027.749	JPY	2.240.690.000	03. Apr. 2024	223.734
USD	3.443.299	JPY	518.161.000	30. Apr. 2024	5.733
USD	8.167.586	JPY	1.228.598.000	08. Mai 2024	6.197
USD	9.500.219	JPY	1.418.950.000	01. Jul. 2024	(3.685)
USD	6.576.882	KRW	8.725.383.000	03. Apr. 2024	95.281
USD	5.451.492	KRW	7.336.153.000	08. Mai 2024	(8.783)
USD	278.603	KZT	127.600.000	20. Jun. 2024	(823)
USD	28.292.179	MXN	481.023.000	03. Apr. 2024	(637.933)
USD	7.423.720	MXN	137.710.000	08. Apr. 2024	(852.156)
USD	202.413	MXN	3.809.000	11. Apr. 2024	(26.388)
USD	188.071	MXN	3.374.000	07. Mai 2024	(13.767)
USD	14.858.916	MXN	248.950.000	08. Mai 2024	(31.097)
USD	11.613.035	MXN	202.591.000	20. Jun. 2024	(420.356)
USD	11.197.669	MXN	200.910.000	28. Jun. 2024	(721.733)
USD	5.396.010	MXN	98.570.000	03. Jul. 2024	(447.399)
USD	10.518.846	MXN	191.220.000	08. Jul. 2024	(808.001)
USD	4.626.436	MXN	80.153.000	10. Jul. 2024	(119.887)
USD	2.668.702	MXN	47.355.000	19. Jul. 2024	(131.450)
USD	2.671.650	MXN	47.355.000	29. Jul. 2024	(124.059)
USD	6.094.782	MXN	107.000.000	23. Aug. 2024	(197.243)
USD	4.262.939	MXN	77.010.000	13. Sep. 2024	(250.574)
USD	5.285.071	MXN	90.890.000	20. Sep. 2024	(36.075)
USD	7.747.489	MXN	137.710.000	07. Okt. 2024	(293.277)
USD	6.821.649	NOK	72.600.000	03. Apr. 2024	134.235
USD	62.446	NOK	650.000	18. Jun. 2024	2.463

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
USD	14.055.943	NZD	23.250.000	03. Apr. 2024	165.227	
USD	284.162	NZD	473.000	08. Mai 2024	1.555	
USD	101.891	NZD	165.000	20. Jun. 2024	3.306	
USD	734.798	PEN	2.725.000	03. Apr. 2024	2.232	
USD	116.710	PEN	435.000	08. Mai 2024	(144)	
USD	1.370.646	PEN	5.057.000	20. Jun. 2024	13.147	
USD	884.258	PHP	49.730.000	03. Apr. 2024	(357)	
USD	256.351	PHP	14.430.000	08. Mai 2024	(185)	
USD	743.774	PHP	41.710.000	20. Jun. 2024	2.801	
USD	8.741.588	PLN	34.795.000	03. Apr. 2024	30.485	
USD	155.527	PLN	620.000	08. Mai 2024	357	
USD	471.493	PLN	1.956.000	14. Mai 2024	(18.013)	
USD	776.368	PLN	3.057.000	20. Jun. 2024	11.677	
USD	16.747.785	SEK	173.023.000	03. Apr. 2024	582.812	
USD	8.823.187	SEK	93.548.000	08. Mai 2024	70.862	
USD	414.750	SEK	4.204.000	20. Jun. 2024	20.698	
USD	5.539.254	SGD	7.444.000	03. Apr. 2024	25.948	
USD	4.035.987	SGD	5.424.000	08. Mai 2024	12.205	
USD	512.562	SGD	680.000	20. Jun. 2024	7.116	
USD	6.766.793	THB	243.535.000	03. Apr. 2024	91.727	
USD	4.286.087	THB	155.365.000	08. Mai 2024	15.502	
USD	990.227	THB	35.410.000	20. Jun. 2024	13.308	
USD	163.760	TRY	5.305.000	03. Apr. 2024	(142)	
USD	157.093	TRY	5.305.000	08. Mai 2024	160	
USD	470.184	TRY	17.105.000	20. Jun. 2024	(11.581)	
USD	163.905	TRY	5.876.000	09. Jul. 2024	1.982	
USD	5.481.500	TWD	173.320.000	03. Apr. 2024	64.911	
USD	27.037.277	ZAR	519.410.000	03. Apr. 2024	(384.592)	
USD	19.363.204	ZAR	367.107.000	08. Mai 2024	36.714	
USD	2.970.725	ZAR	55.852.000	20. Jun. 2024	41.248	
ZAR	519.410.000	USD	27.360.537	03. Apr. 2024	61.334	
ZAR	3.830.000	USD	202.015	08. Mai 2024	(383)	
					USD	227.826
Absicherung der Anteilsklasse						
BRL	65.896.128	USD	13.203.952	30. Apr. 2024	(102.298)	
CHF	10.507.713	USD	11.796.054	30. Apr. 2024	(108.547)	
EUR	87.607.504	USD	95.736.125	30. Apr. 2024	(1.114.816)	
GBP	51.832.791	USD	66.203.520	30. Apr. 2024	(772.782)	
SGD	2.630.080	USD	1.967.921	30. Apr. 2024	(17.540)	
USD	263.582	CHF	237.696	30. Apr. 2024	(802)	
USD	22.174.425	EUR	20.459.996	30. Apr. 2024	76.413	
USD	153.736	GBP	121.638	30. Apr. 2024	187	
USD	25	SGD	34	30. Apr. 2024	-	
					USD	(2.040.185)
					USD	(1.812.359)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Die Devisenterminkontrakte bezogen sich auf die folgenden Kontrahenten:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	ANZ	(61.287)
	Barclays Bank	(11.185)
	BNP Paribas	(7.607)
	Canadian Imperial Bank of Commerce	(327)
	HSBC	(71.453)
	Royal Bank of Canada	(770)
	Standard Chartered Bank	(15.231)
	State Street	(24.683)
	UBS	(4.413)
	USD	(196.956)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	(3.287.727)
	UBS	4.739.729
	USD	1.452.002
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	630.490
	HSBC	(38.566.805)
	USD	(37.936.315)
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Brown Brothers Harriman & Co	77
	HSBC	(1.164.190)
	Morgan Stanley	2.098
	USD	(1.162.015)
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(2.655.299)
	HSBC	2.419.637
	EUR	(235.662)
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	(2.672.908)
	HSBC	(2.467.415)
	J.P. Morgan	(43.551)
	USD	(5.183.874)
Schroder GAIA Oaktree Credit	Brown Brothers Harriman & Co	(5)
	HSBC	(206.214)
	State Street	424.666
	USD	218.447
Schroder GAIA SEG US Equity	HSBC	(2.436.701)
	USD	(2.436.701)
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	(399.833)
	Morgan Stanley	269.833
	USD	(130.000)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	(50.122)
	Deutsche Bank	(164.283)
	HSBC	(1.835.156)
	Morgan Stanley	17.989
	Newedge Group	192.520
	USD	(1.839.052)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	37.582
	Barclays Bank	(606.816)
	BNP Paribas	99.981
	Citi Bank	(204.277)
	Deutsche Bank	695.223
	Goldman Sachs	113.859
	HSBC	(2.331.555)
	J.P. Morgan	614.757
	Morgan Stanley	(429.566)
	Standard Chartered Bank	(15.739)
UBS	214.192	
	USD	(1.812.359)

Kassageschäfte

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

Zum 31. März 2024 war der folgende Teilfonds in offenen Kassageschäften engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
GBP	4.959.103	USD	6.265.856	03. Apr. 2024	(6.725)
USD	11.629	CHF	10.485	04. Apr. 2024	3
				USD	(6.722)

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	(6.722)
	USD	(6.722)

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten“ aufgeführt. Zum 31. März 2024 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Marktwert Risiken), Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Dez. 24	381	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(67.197.289)	95,49	53.616
Mrz. 25	65	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(11.492.027)	95,77	2.879
Jun. 25	60	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(10.632.922)	96,02	(129)
Sep. 25	63	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(11.196.735)	96,22	9.357
Dez. 24	59	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	15.431.047	96,98	620
Mrz. 25	55	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	14.418.736	97,22	2.320
Jun. 25	49	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	12.869.318	97,41	3.641
Sep. 26	16	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	4.216.024	97,72	769

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Mrz. 25	1	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(238.600)	95,43	25
Jun. 25	2	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	478.825	95,70	(325)
Sep. 25	6	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	1.440.063	95,94	(1.038)
Dez. 26	52	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(12.522.988)	96,41	(9.663)
Mrz. 27	48	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(11.559.713)	96,43	(11.288)
Jun. 27	45	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(10.836.038)	96,43	(12.338)
Sep. 27	42	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(10.112.850)	96,43	(12.300)
Dez. 27	41	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.872.438)	96,42	(10.613)
Mrz. 28	42	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(10.110.925)	96,41	(11.600)
Jun. 28	41	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.869.525)	96,39	(10.450)
Jun. 24	337	90 Day Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	217.324.447	9,90	(6.506)
Sep. 24	117	90 Day Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(75.465.080)	9,90	(7.522)
Dez. 24	84	90 Day Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(54.198.075)	9,90	(8.556)
Mrz. 25	83	90 Day Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(53.567.838)	9,91	(11.790)
Apr. 24	10	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1.895.043)	883,28	(10.810)
Jun. 24	449	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(31.246.453)	106,91	(35.650)
Jun. 24	84	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(6.332.745)	116,58	(48.451)
Apr. 24	1.489	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	4.768.489	10.099,75	(116.990)
Apr. 24	115	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	10.000.407	8.223,50	202.304
Jun. 24	667	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(58.851.397)	120,34	(405.758)
Apr. 24	35	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(519.440)	14,37	16.536
Mai 24	50	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(777.430)	15,42	6.505
Jun. 24	20	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	9.718.281	18.776,00	409.963
Jun. 24	33	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	6.494.620	40.176,00	134.420
Jun. 24	6	E-mini S&P 500 ESG Future	Morgan Stanley	USD	1.369.440	468,98	37.500
Jun. 24	8	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	2.114.763	5.308,50	8.638
Jun. 24	21	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(3.000.605)	135,80	(76.059)
Jun. 24	123	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	6.508.686	5.045,00	185.956
Jun. 24	172	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(21.824.930)	118,25	(117.801)
Jun. 24	135	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	17.213.807	119,01	119.375
Jun. 24	115	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(16.409.297)	133,38	(138.859)
Jun. 24	130	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(17.873.739)	128,17	(102.167)
Jun. 24	129	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	12.699.803	7.988,00	306.046
Apr. 24	349	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	4.260.977	12.120,00	(31.097)
Jun. 24	40	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	7.097.457	34.211,00	284.250
Apr. 24	275	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	18.866.669	1.725,00	108.331
Jun. 24	199	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(7.037.797)	68.927,00	(204.269)
Apr. 24	37	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(3.907.895)	16.570,00	(8.663)
Apr. 24	107	Hang Seng TECH Index Future	Morgan Stanley	HKD	(2.353.563)	3.472,00	(19.689)
Apr. 24	40	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(1.475.961)	5.814,00	(9.685)
Apr. 24	24	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(2.770.129)	11.067,10	(95.409)
Mrz. 25	80	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	24.117.130	95,61	16.440
Jun. 25	63	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	19.040.289	95,86	15.588
Sep. 25	58	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	17.560.813	96,06	19.295
Dez. 26	51	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(15.501.678)	96,51	(29.108)
Apr. 24	169	IFSC Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	7.544.069	22.481,50	54.678
Jun. 24	79	Japan 10 Year Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	76.024.130	145,88	105.610
Jun. 24	310	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	21.078.765	375,70	549.276
Jun. 24	38	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	4.760.451	99,94	32.841
Apr. 24	491	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	2.593.064	128.794,00	(71.317)
Jun. 24	381	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	44.554.368	2.357,10	348.388
Jun. 24	311	MSCI Emerging Markets Index Future	Morgan Stanley	USD	16.326.635	1.049,00	(14.685)
Apr. 24	182	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	3.914.294	290,85	6.069
Jun. 24	12	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	4.400.414	18.475,00	33.586

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)								
Jun. 24	22	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	5.787.351	40.230,00	59.260	
Jun. 24	24	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	3.117.679	40.175,00	67.022	
Apr. 24	77	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	(1.768.744)	2.524,50	(47.273)	
Jun. 24	25	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2.636.065	2.145,90	46.310	
Jun. 24	16	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	4.779.315	3.077,40	144.525	
Jun. 24	188	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	36.742.521	1.341,40	492.457	
Jun. 24	684	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	(3.145.967)	833,30	21.734	
Jun. 24	296	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(33.795.806)	105,88	(15.870)	
Jun. 24	480	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	37.379.617	104,85	4.227	
Jun. 24	59	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	4.968.052	113,58	9.642	
Jun. 24	299	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	37.700.150	7.951,00	1.029.835	
Jun. 24	32	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	639.715	189,90	15.881	
Jun. 24	147	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	18.862.172	11.635,00	102.678	
Jun. 24	71	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	12.697.582	2.749,50	198.078	
Jun. 24	32	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	384.919	2.430,00	4.435	
							USD	3.557.178
Schroder GAIA Helix								
Jun. 24	28	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(7.261.360)	5.308,50	(170.540)	
Jun. 24	68	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(1.851.790)	515,80	(42.228)	
Jun. 24	52	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(5.090.205)	7.988,00	(157.033)	
Jun. 24	19	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(941.579)	19.969,00	(17.003)	
Jun. 24	64	FTSE/JSE Top 40 Future	Goldman Sachs	ZAR	(2.297.381)	68.927,00	(32.187)	
Jun. 24	142	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(8.253.520)	575,20	85.680	
Jun. 24	461	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	(9.828.925)	421,30	117.960	
Jun. 24	42	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(4.918.495)	2.357,10	(31.415)	
Jun. 24	267	MSCI Emerging Markets Index Future	J.P. Morgan	USD	(14.030.675)	1.049,00	26.525	
Jun. 24	340	MSCI Europe Future	Goldman Sachs	EUR	(12.198.475)	336,30	(150.461)	
Jun. 24	77	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(1.713.597)	226,60	(31.224)	
Jun. 24	37	MSCI Switzerland Future	J.P. Morgan	CHF	(1.526.091)	3.728,00	(5.340)	
Jun. 24	81	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(8.725.320)	10.906,00	(108.540)	
Jun. 24	12	SPI 200 Future	J.P. Morgan	AUD	(1.530.612)	7.951,00	(25.558)	
Jun. 24	3	Stoxx 600 Banks Future	Goldman Sachs	EUR	28.842	186,60	1.387	
Jun. 24	56	Topix Index Future	Goldman Sachs	JPY	(9.971.747)	2.749,50	(201.830)	
Jun. 24	4	US Ultra Bond Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	(512.674)	129,00	(3.326)	
							USD	(745.133)
Schroder GAIA Oaktree Credit								
Jun. 24	92	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	18.836.173	102,24	(23.610)	
Jun. 24	65	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	6.940.658	107,02	15.358	
							USD	(8.252)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified								
Jun. 24	14	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(3.637.397)	96,36	(944)	
Sep. 24	1	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	260.879	96,68	(121)	
Dez. 24	60	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(15.668.947)	96,98	(24.274)	
Mrz. 25	54	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	14.145.018	97,22	13.836	
Jun. 25	76	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	19.915.719	97,41	50.504	
Sep. 24	1	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(237.363)	94,87	200	
Dez. 24	87	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(20.726.650)	95,14	34.788	
Mrz. 25	212	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(50.653.089)	95,43	75.189	
Jun. 25	176	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(42.216.396)	95,70	108.395	
Sep. 25	110	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(26.483.613)	95,94	101.488	
Dez. 25	65	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(15.654.713)	96,12	35.213	
Mrz. 26	17	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(4.091.663)	96,25	1.250	
Jun. 26	34	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	8.230.588	96,33	(42.963)	
Sep. 26	29	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	6.987.100	96,38	88	

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Apr. 24	10	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1.865.418)	883,28	(40.436)
Jun. 24	18	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	1.252.762	106,91	1.309
Jun. 24	9	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	681.753	116,58	1.946
Jun. 24	1	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	66.020	65,33	(690)
Jun. 24	3	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	239.306	126,27	(2.550)
Apr. 24	51	CAC 40 Index Future	Citi Bank	EUR	4.475.849	8.223,50	48.832
Jun. 24	180	Canada 10 Year Bond Future	Citi Bank	CAD	(15.896.741)	120,34	(94.696)
Jun. 24	3	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(222.225)	73,94	405
Apr. 24	50	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	768.627	14,37	(50.192)
Mai 24	31	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(496.196)	15,42	18.223
Jun. 24	20	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	(9.918.299)	18.776,00	(209.944)
Jun. 24	81	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(15.900.721)	40.176,00	(370.559)
Jun. 24	192	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	50.182.144	5.308,50	779.456
Jun. 24	9	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Newedge Group	EUR	(1.287.478)	135,80	(31.092)
Jun. 24	2	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	(273.138)	1,08	2.600
Jun. 24	166	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	8.848.623	5.045,00	186.421
Jun. 24	95	Euro Stoxx Banks Future	Morgan Stanley	EUR	652.310	135,40	41.552
Jun. 24	125	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(15.884.717)	118,25	(62.034)
Jun. 24	158	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	19.993.399	119,01	292.843
Jun. 24	175	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(24.919.320)	133,38	(262.657)
Jun. 24	85	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	(11.669.704)	128,17	(83.773)
Jun. 24	170	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(19.365.913)	105,70	(19.943)
Jun. 24	5	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	502.859	7.988,00	1.243
Apr. 24	279	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(3.398.407)	12.120,00	16.927
Jun. 24	20	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	3.592.570	34.211,00	98.283
Jun. 24	70	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2.475.725)	68.927,00	(71.736)
Apr. 24	1	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(113.004)	11.067,10	(6.393)
Mrz. 25	9	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	2.711.335	95,61	3.692
Apr. 24	54	IFSC Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	2.402.097	22.481,50	25.905
Jun. 24	25	Japan 10 Year Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	24.026.457	145,88	65.233
Jun. 24	2	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(171.156)	66,86	4.018
Jun. 24	13	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	143.135	1.534,90	5.082
Jun. 24	125	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(8.445.079)	375,70	(275.905)
Jun. 24	104	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	12.923.015	99,94	195.469
Jun. 24	7	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	205.201	5,95	2.874
Jun. 24	21	MSCI EAFE Index Future	Citi Bank	USD	(2.442.510)	2.357,10	(32.445)
Jun. 24	124	MSCI Emerging Markets Index Future	Citi Bank	USD	(6.496.706)	1.049,00	(7.094)
Apr. 24	53	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(1.138.404)	290,85	(3.240)
Jun. 24	93	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	34.525.491	18.475,00	(161.991)
Jun. 24	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(61.250)	59,75	1.500
Jun. 24	12	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	3.151.348	40.230,00	37.713
Jun. 24	21	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(2.766.498)	40.360,00	(32.947)
Apr. 24	86	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	(2.010.308)	2.524,50	(17.971)
Jun. 24	107	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(11.246.590)	2.145,90	(233.975)
Jun. 24	9	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2.687.645	3.077,40	82.015
Jun. 24	22	S&P/TSX 60 Index Future	Citi Bank	CAD	4.291.372	1.341,40	65.913
Jun. 24	52	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	238.750	833,30	(1.235)
Jun. 24	59	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	6.726.932	105,88	12.558
Jun. 24	233	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	(19.569.746)	113,58	(87.926)
Jun. 24	16	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1.244.702	104,85	1.426
Jun. 24	33	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	4.172.938	7.951,00	101.609
Jun. 24	1	Stoxx 600 Banks Future	Newedge Group	EUR	9.985	186,60	81
Jun. 24	48	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	1.295.759	510,80	26.824
Jun. 24	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	142.969	111,82	(3.194)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)								
Apr. 24	57	TAIEX Future	Newedge Group	TWD	7.066.946	20.202,00	129.230	
Jun. 24	20	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(3.535.143)	2.749,50	(97.437)	
Jun. 24	162	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	17.862.703	110,80	86.391	
Jun. 24	29	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(3.301.922)	114,61	(21.750)	
Jun. 24	116	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(23.734.195)	102,24	14.008	
Jun. 24	4	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	833.898	104,28	351	
Jun. 24	251	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(26.786.228)	107,02	(74.694)	
Apr. 24	23	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	224.559	1.345,90	5.382	
Jun. 24	1	US Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	102.559	104,27	1.710	
Jun. 24	39	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4.622.836)	120,44	(74.227)	
Jun. 24	3	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(389.344)	129,00	2.344	
Apr. 24	142	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(231.970)	14,15	15.197	
Jun. 24	25	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(306.191)	2.430,00	2.008	
							USD	298.496
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Sep. 24	194	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	46.009.088	94,87	437	
Jun. 24	21	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1.591.636	116,58	3.663	
Jun. 24	18	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1.254.209	106,91	(138)	
Jun. 24	16	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	1.418.092	120,34	3.369	
Jun. 24	13	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(1.071.714)	111,47	1.905	
Jun. 24	7	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(1.849.650)	5.308,50	(8.325)	
Jun. 24	31	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(1.643.339)	5.045,00	(43.928)	
Jun. 24	111	Euro Stoxx Banks Future	Morgan Stanley	EUR	(775.172)	135,40	(35.551)	
Jun. 24	3	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(382.366)	118,25	(356)	
Jun. 24	2	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(285.593)	133,38	(2.201)	
Jun. 24	19	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(2.166.271)	105,70	(383)	
Jun. 24	1	Japan 10 Year Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(962.082)	145,88	(1.586)	
Jun. 24	11	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(1.381.423)	99,94	(6.109)	
Jun. 24	41	S&P 500 Micro E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.065.724)	5.308,50	(22.519)	
Jun. 24	5	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	(889.219)	2.749,50	(18.926)	
Jun. 24	38	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4.199.656)	110,80	(10.625)	
Jun. 24	8	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(923.500)	114,61	6.625	
Jun. 24	159	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	32.524.766	102,24	(11.750)	
Jun. 24	280	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(29.987.056)	107,02	22.681	
Jun. 24	2	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(245.547)	120,44	4.672	
Jun. 24	18	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	2.291.281	129,00	30.719	
							USD	(88.326)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 31. März 2024 waren die folgenden Teilfonds in offenen Optionskontrakten auf Finanzindizes und international notierte Aktien engagiert:

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend						
(4.495.649)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 58,32 Verfallstermin 28. Mrz. 2024	UBS	USD	(14.833)	-	14.833
				USD	-	14.833
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
2.884	Call auf Paramount Global Ausübungskurs 17,50 Verfallstermin 21. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	236.488	77.868	(158.620)
(2.884)	Call auf Paramount Global Ausübungskurs 22,50 Verfallstermin 21. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	(60.564)	(21.630)	38.934
				USD	56.238	(119.686)
Schroder GAIA Helix						
229	Call auf Hang Seng Index Ausübungskurs 17.100,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	J.P. Morgan	HKD	344.201	198.966	(145.235)
5	Put auf CBOE Mini Index Ausübungskurs 4.850,00 Verfallstermin 21. Jun. 2024	UBS	USD	24.319	13.325	(10.994)
23	Put auf CBOE Mini Index Ausübungskurs 5.000,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	UBS	USD	62.416	14.950	(47.466)
17	Put auf CBOE Mini Index Ausübungskurs 5.100,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	UBS	USD	28.623	21.335	(7.288)
71	Put auf Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 17.400,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	UBS	EUR	27.880	7.994	(19.886)
5.443.927	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 146,00 Verfallstermin 17. Apr. 2024	Goldman Sachs	USD	28.494	5.816	(22.678)
60	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.600,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	UBS	GBP	31.556	4.358	(27.198)
74	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.800,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	UBS	GBP	28.231	21.267	(6.964)
(55)	Put auf Hang Seng Index Ausübungskurs 16.000,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	UBS	HKD	(50.070)	(40.056)	10.014
153.500	Put auf JPHEUML1 Index Ausübungskurs 106,45 Verfallstermin 19. Apr. 2024	J.P. Morgan	USD	227.042	112.950	(114.092)
20	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.010,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	11.874	4.950	(6.924)
20	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 940,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	UBS	USD	12.874	1.050	(11.824)
				USD	366.905	(410.535)
Schroder GAIA SEG US Equity						
500	Call auf 3M Co. Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 20. Jun. 2025	Goldman Sachs	USD	501.442	758.749	257.307
326	Call auf Citizens Financial Group, Inc. Ausübungskurs 27,50 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	300.001	407.500	107.499

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA SEG US Equity (Forts.)						
196	Call auf Coherent Corp. Ausübungskurs 40,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Goldman Sachs	USD	224.777	503.720	278.943
257	Call auf Coherent Corp. Ausübungskurs 75,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	339.195	355.945	16.750
170	Call auf eBay, Inc. Ausübungskurs 50,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	178.844	184.450	5.606
623	Call auf Intel Corp. Ausübungskurs 30,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Goldman Sachs	USD	593.320	985.898	392.578
1.142	Call auf Intel Corp. Ausübungskurs 55,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	1.038.954	947.860	(91.094)
211	Call auf PayPal Holdings, Inc. Ausübungskurs 70,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	304.911	327.578	22.667
1.645	Call auf Pinterest, Inc. Ausübungskurs 40,00 Verfallstermin 20. Jun. 2025	Goldman Sachs	USD	1.005.139	908.863	(96.276)
26	Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2.100,00 Verfallstermin 20. Jun. 2025	Goldman Sachs	USD	479.271	657.800	178.529
1.366	Call auf VF Corp. Ausübungskurs 17,50 Verfallstermin 19. Sep. 2025	Goldman Sachs	USD	386.615	424.143	37.528
95	Call auf Eli Lilly & Co. Ausübungskurs 500,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	327.753	276.450	(51.303)
				USD	6.738.956	1.058.734
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
274	Call auf Antero Resources Corp. Ausübungskurs 33,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	76.185	82.610	6.425
45	Call auf Apple, Inc. Ausübungskurs 180,00 Verfallstermin 26. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.220	4.927	(293)
45	Call auf Apple, Inc. Ausübungskurs 185,00 Verfallstermin 05. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	3.096	112	(2.984)
4	Call auf Broadcom, Inc. Ausübungskurs 1.470,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	11.351	2.379	(8.972)
(46)	Call auf Celsius Holdings, Inc. Ausübungskurs 100,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	(21.879)	(12.697)	9.182
17	Call auf Charter Communications, Inc. Ausübungskurs 330,00 Verfallstermin 28. März 2024	Morgan Stanley	USD	2.593	85	(2.508)
57	Call auf Chesapeake Energy Corp. Ausübungskurs 100,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	22.709	28.500	5.791
88	Call auf EchoStar Corp. Ausübungskurs 20,00 Verfallstermin 19. Jul. 2024	Morgan Stanley	USD	11.673	6.292	(5.381)
(51)	Call auf elf Beauty, Inc. Ausübungskurs 260,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	(29.464)	(8.288)	21.176
108	Call auf Endeavor Group Holdings, Inc. Ausübungskurs 26,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	7.702	7.560	(142)
11	Call auf Enphase Energy, Inc. Ausübungskurs 122,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.555	7.013	1.458

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
258	Call auf EQT Corp. Ausübungskurs 43,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	91.156	70.692	(20.464)
(4.905.000)	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,64 Verfallstermin 17. Apr. 2024	Bank of America	AUD	(90.429)	(68.626)	21.803
360.000	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,65 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Bank of America	AUD	2.174	682	(1.492)
355.000	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,66 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Bank of America	AUD	2.090	861	(1.229)
4.905.000	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 17. Apr. 2024	Bank of America	AUD	33.578	1.385	(32.193)
211.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,65 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Morgan Stanley	EUR	1.629	1.095	(534)
216.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,66 Verfallstermin 25. Apr. 2024	Bank of America	EUR	1.532	1.256	(276)
224.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,08 Verfallstermin 03. Mai 2024	UBS	EUR	3.175	1.624	(1.551)
214.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 18. Apr. 2024	UBS	EUR	1.404	267	(1.137)
214.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 19. Jun. 2024	HSBC	EUR	2.528	1.598	(930)
211.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Bank of America	EUR	1.569	79	(1.490)
185.000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,93 Verfallstermin 25. Apr. 2024	Morgan Stanley	GBP	1.556	1.670	114
183.000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 189,02 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Morgan Stanley	GBP	1.986	2.852	866
186.000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 189,81 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Morgan Stanley	GBP	1.996	1.842	(154)
190.000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,27 Verfallstermin 30. Apr. 2024	Barclays Bank	GBP	3.385	695	(2.690)
102.000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Barclays Bank	GBP	1.507	642	(865)
385.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 03. Jun. 2024	HSBC	NZD	3.866	1.370	(2.496)
385.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Bank of America	NZD	2.168	10	(2.158)
1.077.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,93 Verfallstermin 08. Apr. 2024	Bank of America	USD	27.920	18.798	(9.122)
241.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,97 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	5.400	4.204	(1.196)
348.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,99 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Deutsche Bank	USD	3.535	3.370	(165)
1.418.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,00 Verfallstermin 17. Apr. 2024	UBS	USD	15.073	14.075	(998)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Wahrung	Premie bezahlt/ (erhalten)	Markt-wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
349.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausbungskurs 5,00 Verfallstermin 29. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	3.668	4.692	1.024
233.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausbungskurs 5,02 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	4.511	4.741	230
1.778.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausbungskurs 5,04 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	19.645	12.371	(7.274)
532.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausbungskurs 5,06 Verfallstermin 23. Jul. 2024	Bank of America	USD	19.714	12.494	(7.220)
312.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausbungskurs 5,22 Verfallstermin 03. Apr. 2024	Bank of America	USD	3.430	10	(3.420)
1.491.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausbungskurs 5,52 Verfallstermin 01. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	24.870	-	(24.870)
241.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausbungskurs 1,35 Verfallstermin 07. Mai 2024	Goldman Sachs	USD	2.498	2.224	(274)
231.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausbungskurs 1,35 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Bank of America	USD	1.330	1.585	255
233.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausbungskurs 1,35 Verfallstermin 21. Jun. 2024	UBS	USD	2.209	2.653	444
242.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausbungskurs 0,86 Verfallstermin 03. Mai 2024	UBS	USD	3.473	9.952	6.479
(240.000)	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausbungskurs 0,88 Verfallstermin 14. Mai 2024	Goldman Sachs	USD	(3.214)	(5.510)	(2.296)
232.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausbungskurs 0,88 Verfallstermin 19. Jun. 2024	UBS	USD	2.841	4.892	2.051
2.588.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausbungskurs 0,89 Verfallstermin 08. Nov. 2024	UBS	USD	26.786	45.119	18.333
(232.000)	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausbungskurs 0,90 Verfallstermin 27. Jun. 2024	UBS	USD	(2.945)	(2.482)	463
(242.000)	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausbungskurs 953,50 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	(6.693)	(8.070)	(1.377)
348.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbungskurs 7,18 Verfallstermin 11. Apr. 2024	HSBC	USD	1.023	4.184	3.161
349.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbungskurs 7,19 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	1.056	3.380	2.324
1.725.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbungskurs 7,35 Verfallstermin 05. Mrz. 2025	J.P. Morgan	USD	13.019	18.615	5.596
1.704.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausbungskurs 7,35 Verfallstermin 18. Feb. 2025	BNP Paribas	USD	15.847	17.905	2.058
232.000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausbungskurs 3.902,35 Verfallstermin 27. Jun. 2024	Barclays Bank	USD	4.816	5.579	763
240.000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausbungskurs 3.980,00 Verfallstermin 14. Mai 2024	Bank of America	USD	6.521	1.744	(4.777)
1.882.000	Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausbungskurs 24,68 Verfallstermin 16. Apr. 2024	Bank of America	USD	21.088	210	(20.878)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.437.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 362,95 Verfallstermin 09. Apr. 2024	J.P. Morgan	USD	16.215	13.290	(2.925)
355.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 364,36 Verfallstermin 02. Apr. 2024	J.P. Morgan	USD	4.027	1.512	(2.515)
1.437.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 366,05 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Goldman Sachs	USD	15.540	4.210	(11.330)
351.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 366,45 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Goldman Sachs	USD	3.952	1.818	(2.134)
(1.882.000)	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 406,50 Verfallstermin 16. Apr. 2024	Citi Bank	USD	(31.226)	(74)	31.152
(349.000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,57 Verfallstermin 02. Apr. 2024	Bank of America	USD	(4.125)	(10.175)	(6.050)
242.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,34 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	1.419	924	(495)
2.043.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,49 Verfallstermin 04. Sep. 2024	Goldman Sachs	USD	16.906	20.693	3.787
244.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 143,15 Verfallstermin 12. Apr. 2024	Bank of America	USD	4.508	12.808	8.300
(241.000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 144,36 Verfallstermin 02. Mai 2024	BNP Paribas	USD	(4.595)	(10.315)	(5.720)
(233.000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 146,18 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	(3.935)	(6.876)	(2.941)
(347.000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 147,00 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	(3.456)	(9.732)	(6.276)
237.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 148,55 Verfallstermin 24. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	3.596	4.343	747
233.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 150,50 Verfallstermin 25. Apr. 2024	Bank of America	USD	2.068	2.224	156
(348.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 16,83 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Bank of America	USD	(2.727)	(899)	1.828
233.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 16,94 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	4.052	2.912	(1.140)
(352.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 16,95 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	(2.934)	(152)	2.782
241.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,39 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	5.140	382	(4.758)
1.274.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,87 Verfallstermin 03. Mai 2024	Deutsche Bank	USD	45.979	871	(45.108)
1.229.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,39 Verfallstermin 10. Mai 2024	Bank of America	USD	43.204	588	(42.616)
(1.229.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,69 Verfallstermin 10. Mai 2024	Bank of America	USD	(19.674)	(137)	19.537
(233.000)	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,30 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	(4.028)	(8.954)	(4.926)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(241.000)	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,39 Verfallstermin 02. Mai 2024	HSBC	USD	(4.997)	(7.229)	(2.232)
(348.000)	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,63 Verfallstermin 11. Apr. 2024	HSBC	USD	(4.382)	(6.723)	(2.341)
1.084.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 19,28 Verfallstermin 02. Apr. 2024	Bank of America	USD	15.778	531	(15.247)
311.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 19,74 Verfallstermin 09. Apr. 2024	UBS	USD	3.729	135	(3.594)
22	Call auf Lululemon Athletica, Inc. Ausübungskurs 430,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	9.153	2.134	(7.019)
18	Call auf Madison Square Garden Sports Corp. Ausübungskurs 210,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	5.554	1.008	(4.546)
39	Call auf Maplebear, Inc. Ausübungskurs 40,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	3.985	1.950	(2.035)
30	Call auf Marvell Technology, Inc. Ausübungskurs 70,00 Verfallstermin 26. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.828	12.825	6.997
6	Call auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 520,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	6.846	1.695	(5.151)
8	Call auf MSCI Emerging Markets Ausübungskurs 1.080,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	7.907	6.080	(1.827)
(10)	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 1.050,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	(35.858)	(19.400)	16.458
79	Call auf PayPal Holdings, Inc. Ausübungskurs 70,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	9.584	8.058	(1.526)
2	Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2.170,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.595	3.910	(685)
8	Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2.190,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	29.611	28.280	(1.331)
460	Call auf S&P North American Expanded Technology Software Index Ausübungskurs 862,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	3.616	1.218	(2.398)
22	Call auf Snowflake, Inc. Ausübungskurs 170,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.629	6.182	1.553
165	Call auf SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF Ausübungskurs 5.955,00 Verfallstermin 26. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	14.175	31.897	17.722
28	Call auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 190,00 Verfallstermin 05. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.312	2.758	(1.554)
29	Call auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 215,00 Verfallstermin 28. März 2024	Morgan Stanley	USD	15.829	29	(15.800)
23	Call auf TKO Group Holdings, Inc. Ausübungskurs 91,14 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.888	1.725	(3.163)
83	Call auf TripAdvisor, Inc. Ausübungskurs 30,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.406	2.283	(2.123)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
32	Call auf Twilio, Inc. Ausübungskurs 85,00 Verfallstermin 21. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	10.795	1.680	(9.115)
8.727	Call auf Ubisoft Entertainment SA Ausübungskurs 32,00 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Goldman Sachs	EUR	20.143	5.156	(14.987)
45	Call auf Walt Disney Co. Ausübungskurs 135,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	8.052	7.223	(829)
33	Call auf Wayfair, Inc. Ausübungskurs 74,00 Verfallstermin 26. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	11.413	8.003	(3.410)
(17)	Put auf Advanced Micro Devices, Inc. Ausübungskurs 160,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.160)	(1.590)	570
17	Put auf Advanced Micro Devices, Inc. Ausübungskurs 180,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	9.157	11.433	2.276
45	Put auf Alphabet, Inc. Ausübungskurs 145,00 Verfallstermin 26. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	10.221	9.900	(321)
62	Put auf Amazon.com, Inc. Ausübungskurs 165,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	3.957	2.108	(1.849)
(274)	Put auf Antero Resources Corp. Ausübungskurs 20,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	(40.479)	(21.098)	19.381
176.995	Put auf Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA Ausübungskurs 10,00 Verfallstermin 21. Jun. 2024	Goldman Sachs	EUR	51.382	40.174	(11.208)
40	Put auf Blackstone, Inc. Ausübungskurs 115,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	7.300	1.380	(5.920)
391	Put auf Carlyle Group, Inc. Ausübungskurs 42,50 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	35.705	4.888	(30.817)
285	Put auf Carlyle Group, Inc. Ausübungskurs 45,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	39.135	38.475	(660)
119	Put auf CBOE Mini Index Ausübungskurs 500,00 Verfallstermin 05. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	10.371	952	(9.419)
46	Put auf Celsius Holdings, Inc. Ausübungskurs 85,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	37.751	40.250	2.499
17	Put auf Charter Communications, Inc. Ausübungskurs 250,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	7.590	850	(6.740)
(57)	Put auf Chesapeake Energy Corp. Ausübungskurs 60,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	(9.670)	(7.553)	2.117
(11)	Put auf Coinbase Global, Inc. Ausübungskurs 190,00 Verfallstermin 12. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.778)	(600)	1.178
11	Put auf Coinbase Global, Inc. Ausübungskurs 225,00 Verfallstermin 12. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	8.717	3.520	(5.197)
119	Put auf Comcast Corp. Ausübungskurs 41,00 Verfallstermin 26. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	9.809	7.616	(2.193)
6	Put auf Costco Wholesale Corp. Ausübungskurs 700,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	4.984	3.720	(1.264)
28	Put auf Digital Realty Trust, Inc. Ausübungskurs 137,00 Verfallstermin 12. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	6.017	2.450	(3.567)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
3.290	Put auf Dow Jones U.S. Real Estate Index Ausübungskurs 217,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.639	4.639	-
11	Put auf Blackstone, Inc. Ausübungskurs 200,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.713	2.530	(2.183)
51	Put auf elf Beauty, Inc. Ausübungskurs 180,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	47.437	37.230	(10.207)
(258)	Put auf EQT Corp. Ausübungskurs 28,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	(35.522)	(27.477)	8.045
5	Put auf Equinix, Inc. Ausübungskurs 710,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	6.481	2.775	(3.706)
5	Put auf Equinix, Inc. Ausübungskurs 770,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.440	2.000	(3.440)
12.136	Put auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 132,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Goldman Sachs	EUR	19.828	18.760	(1.068)
3.465.000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,65 Verfallstermin 01. Mai 2024	Morgan Stanley	AUD	21.125	15.998	(5.127)
360.000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,65 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Bank of America	AUD	2.174	1.066	(1.108)
355.000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,66 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Bank of America	AUD	2.090	2.811	721
211.000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,65 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Morgan Stanley	EUR	1.629	760	(869)
216.000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,66 Verfallstermin 25. Apr. 2024	Bank of America	EUR	1.532	1.467	(65)
1.721.000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,34 Verfallstermin 10. Mai 2024	Barclays Bank	EUR	13.020	15.896	2.876
224.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,08 Verfallstermin 03. Mai 2024	UBS	EUR	3.175	1.395	(1.780)
214.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 18. Apr. 2024	UBS	EUR	1.404	2.852	1.448
214.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 19. Jun. 2024	HSBC	EUR	2.528	3.136	608
211.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Bank of America	EUR	1.569	3.496	1.927
185.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,93 Verfallstermin 25. Apr. 2024	Morgan Stanley	GBP	1.556	1.079	(477)
183.000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 189,02 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Morgan Stanley	GBP	1.986	918	(1.068)
186.000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 189,81 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Morgan Stanley	GBP	1.996	366	(1.630)
940.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,22 Verfallstermin 29. Mai 2024	Bank of America	GBP	10.063	1.486	(8.577)
190.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,27 Verfallstermin 30. Apr. 2024	Barclays Bank	GBP	3.385	2.973	(412)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
102.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Barclays Bank	GBP	1.507	2.612	1.105
3.760.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,60 Verfallstermin 17. Apr. 2024	Bank of America	NZD	21.022	27.889	6.867
3.735.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,60 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Bank of America	NZD	21.710	31.096	9.386
385.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 03. Jun. 2024	HSBC	NZD	3.866	5.933	2.067
385.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Bank of America	NZD	2.168	4.937	2.769
(1.082.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,71 Verfallstermin 09. Jul. 2024	Morgan Stanley	USD	(13.495)	(1.383)	12.112
(1.491.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,80 Verfallstermin 01. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	(19.562)	-	19.562
(506.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,87 Verfallstermin 26. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	(3.345)	(2.535)	810
1.077.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,93 Verfallstermin 08. Apr. 2024	Bank of America	USD	25.770	618	(25.152)
241.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,97 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	5.400	1.223	(4.177)
1.082.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,99 Verfallstermin 09. Jul. 2024	Morgan Stanley	USD	39.138	14.809	(24.329)
348.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,99 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Deutsche Bank	USD	3.535	1.329	(2.206)
349.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,00 Verfallstermin 29. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	3.668	2.430	(1.238)
233.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,02 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	4.511	3.299	(1.212)
506.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,03 Verfallstermin 26. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	9.801	8.018	(1.783)
532.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,06 Verfallstermin 23. Jul. 2024	Bank of America	USD	17.620	11.036	(6.584)
(3.107.000)	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 17. Apr. 2024	Bank of America	USD	(18.682)	(207)	18.475
241.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 07. Mai 2024	Goldman Sachs	USD	2.498	864	(1.634)
231.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Bank of America	USD	1.330	396	(934)
233.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 21. Jun. 2024	UBS	USD	2.209	1.685	(524)
3.107.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Verfallstermin 17. Apr. 2024	Bank of America	USD	52.076	22.434	(29.642)
(2.588.000)	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,82 Verfallstermin 08. Nov. 2024	UBS	USD	(29.115)	(6.237)	22.878

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Wahrung	Premie bezahlt/ (erhalten)	Markt-wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
242.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,86 Verfallstermin 03. Mai 2024	UBS	USD	3.473	33	(3.440)
(240.000)	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,88 Verfallstermin 14. Mai 2024	Goldman Sachs	USD	(3.214)	(431)	2.783
232.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,88 Verfallstermin 19. Jun. 2024	UBS	USD	2.841	1.290	(1.551)
(232.000)	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,90 Verfallstermin 27. Jun. 2024	UBS	USD	(2.945)	(3.317)	(372)
(242.000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausungskurs 953,50 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	(6.693)	(1.365)	5.328
(1.725.000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausungskurs 6,82 Verfallstermin 05. Mrz. 2025	J.P. Morgan	USD	(14.566)	(10.855)	3.711
(1.704.000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausungskurs 6,84 Verfallstermin 18. Feb. 2025	BNP Paribas	USD	(16.495)	(10.757)	5.738
348.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausungskurs 7,18 Verfallstermin 11. Apr. 2024	HSBC	USD	1.023	128	(895)
349.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausungskurs 7,19 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	1.056	67	(989)
1.082.000	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausungskurs 3.755,00 Verfallstermin 09. Jul. 2024	Morgan Stanley	USD	17.487	6.988	(10.499)
232.000	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausungskurs 3.902,35 Verfallstermin 27. Jun. 2024	Barclays Bank	USD	4.816	4.405	(411)
240.000	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausungskurs 3.980,00 Verfallstermin 14. Mai 2024	Bank of America	USD	6.521	7.076	555
(1.082.000)	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausungskurs 4.055,00 Verfallstermin 09. Jul. 2024	Morgan Stanley	USD	(49.580)	(48.210)	1.370
(1.882.000)	Put auf USD/CZK-Devisenkurs Ausungskurs 22,50 Verfallstermin 16. Apr. 2024	Bank of America	USD	(17.879)	(90)	17.789
1.882.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausungskurs 353,80 Verfallstermin 16. Apr. 2024	Citi Bank	USD	23.284	737	(22.547)
355.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausungskurs 364,36 Verfallstermin 02. Apr. 2024	J.P. Morgan	USD	4.027	929	(3.098)
351.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausungskurs 366,45 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Goldman Sachs	USD	3.952	3.012	(940)
(349.000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausungskurs 3,57 Verfallstermin 02. Apr. 2024	Bank of America	USD	(4.125)	(12)	4.113
1.876.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausungskurs 82,38 Verfallstermin 08. Apr. 2024	Bank of America	USD	8.560	133	(8.427)
613.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausungskurs 82,38 Verfallstermin 09. Mai 2024	UBS	USD	2.697	281	(2.416)
242.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausungskurs 83,34 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	1.419	575	(844)
2.043.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausungskurs 83,49 Verfallstermin 04. Sep. 2024	Goldman Sachs	USD	16.906	12.214	(4.692)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Wahrung	Premie bezahlt/ (erhalten)	Markt-wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
244.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausbungskurs 143,15 Verfallstermin 12. Apr. 2024	Bank of America	USD	4.508	60	(4.448)
(241.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausbungskurs 144,36 Verfallstermin 02. Mai 2024	BNP Paribas	USD	(4.611)	(310)	4.301
(233.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausbungskurs 146,18 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	(3.935)	(1.583)	2.352
(347.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausbungskurs 147,00 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	(3.456)	(271)	3.185
237.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausbungskurs 148,55 Verfallstermin 24. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	3.596	1.926	(1.670)
233.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausbungskurs 150,50 Verfallstermin 25. Apr. 2024	Bank of America	USD	2.068	1.755	(313)
(348.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 16,83 Verfallstermin 11. Apr. 2024	Bank of America	USD	(2.727)	(4.630)	(1.903)
233.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 16,94 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	4.052	4.558	506
(352.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 16,95 Verfallstermin 04. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	(2.934)	(6.778)	(3.844)
241.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 17,39 Verfallstermin 02. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	5.140	10.278	5.138
1.274.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 17,87 Verfallstermin 03. Mai 2024	Deutsche Bank	USD	41.317	88.866	47.549
(233.000)	Put auf USD/SEK-Devisenkurs Ausbungskurs 10,30 Verfallstermin 14. Jun. 2024	Morgan Stanley	USD	(4.028)	(958)	3.070
(241.000)	Put auf USD/SEK-Devisenkurs Ausbungskurs 10,39 Verfallstermin 02. Mai 2024	HSBC	USD	(4.997)	(416)	4.581
538.000	Put auf USD/TRY-Devisenkurs Ausbungskurs 33,29 Verfallstermin 08. Jul. 2024	Bank of America	USD	8.463	1.623	(6.840)
(348.000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausbungskurs 18,63 Verfallstermin 11. Apr. 2024	HSBC	USD	(4.382)	(800)	3.582
23	Put auf International Business Machines Corp. Ausbungskurs 180,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	7.997	1.093	(6.904)
23	Put auf Microsoft Corp. Ausbungskurs 400,00 Verfallstermin 26. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	7.580	6.095	(1.485)
5	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausbungskurs 3.600,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	31.657	28.000	(3.657)
(6)	Call auf NVIDIA Corp. Ausbungskurs 720,00 Verfallstermin 28. Mrz. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.875)	(6)	2.869
10	Call auf NVIDIA Corp. Ausbungskurs 825,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	51.845	24.050	(27.795)
6	Call auf NVIDIA Corp. Ausbungskurs 830,00 Verfallstermin 28. Mrz. 2024	Morgan Stanley	USD	13.915	6	(13.909)
104	Put auf Philadelphia Semiconductor Index Ausbungskurs 4.530,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	7.488	6.206	(1.282)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
181	Put auf Philadelphia Semiconductor Index Ausübungskurs 4.635,00 Verfallstermin 28. Mrz. 2024	J.P. Morgan	USD	6.832	-	(6.832)	
22	Put auf Roku, Inc. Ausübungskurs 59,00 Verfallstermin 28. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	2.160	22	(2.138)	
3	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5.000,00 Verfallstermin 28. Mrz. 2024	Morgan Stanley	USD	10.871	38	(10.833)	
7	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5.125,00 Verfallstermin 17. Mai 2024	Morgan Stanley	USD	31.866	26.950	(4.916)	
(132)	Put auf S&P Retail Select Industry Index Ausübungskurs 7.284,00 Verfallstermin 28. Mrz. 2024	Morgan Stanley	USD	(3.070)	-	3.070	
132	Put auf S&P Retail Select Industry Index Ausübungskurs 7.812,00 Verfallstermin 28. Mrz. 2024	Morgan Stanley	USD	14.752	-	(14.752)	
63	Put auf Shopify, Inc. Ausübungskurs 69,00 Verfallstermin 28. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.614	63	(5.551)	
4.867	Put auf SoftBank Group Corp. Ausübungskurs 7.668,90 Verfallstermin 15. Apr. 2024	Goldman Sachs	JPY	8.537	557	(7.980)	
28	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	10.481	4.466	(6.015)	
34	Put auf Trade Desk, Inc. Ausübungskurs 77,00 Verfallstermin 05. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.027	102	(4.925)	
153	Put auf Walmart, Inc. Ausübungskurs 58,33 Verfallstermin 19. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	4.179	2.601	(1.578)	
85	Put auf Walt Disney Co. Ausübungskurs 110,00 Verfallstermin 05. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.496	298	(5.198)	
					USD	955.860	(357.547)

Swaptions

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

Zum 31. März 2024 waren die folgenden Teilfonds in offenen Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien engagiert:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 7,69 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz 2026", Put 7,69 %, 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	312.142	(71.981)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2030", Call 6,80 %, 04. Feb. 2030	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	18.506	(523.170)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,06 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Jun 2024", Call 7,06 %, 26. Jun. 2024	J.P. Morgan	MXN	195.967	188.310.000	576	(195.391)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Swaptions (Forts.)

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)								
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Mrz 2026", Call 7,29 %, 05. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	90.347	(306.177)	
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,96 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Jan 2025", Call 7,96 %, 21. Jan. 2025	J.P. Morgan	MXN	101.038	91.350.000	58.484	(42.554)	
Kauf	SWP "Erhält Festzinssatz 8,05 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Jul 2023", Call 8,05 %, 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	73.126	17.150.000	40.865	(32.261)	
Kauf	SWP "Zahlt Festzinssatz 9,74 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIE Apr 2028", Put; 9,74 %; 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	76.455	17.150.000	43.017	(33.439)	
Verkauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,21 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Jan 2025", Call 7,21 %, 21. Jan. 2025	J.P. Morgan	MXN	(30.522)	91.350.000	(15.727)	14.795	
						USD	548.210	(1.190.178)

Total Return Swapkontrakte

Die Teilfonds dürfen Total Return Swaps abschließen. Ein Total Return Swap ist ein bilateraler finanzieller Vertrag, der es ihnen 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 variabel Bezahlung) für ihre Rechte darauf bezahlen, die Gesamrendite der Referenzanlagen (Coupons und/oder Kapitalgewinne und/oder -verluste) zu erhalten. Bei der Referenzanlage kann es sich um fast jede beliebige Anlage handeln, die eine für die Teilfonds zulässige Anlage darstellt. Die Teilfonds können solche Instrumente für die Aufnahme von Positionen in einem qualifizierten Markt oder zu Absicherungszwecken einsetzen.

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

Zum 31. März 2024 waren folgende Teilfonds in Total Return Swapkontrakten engagiert:

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	GBP	5.346.026	21. Aug. 2024	5.352.641
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	11.118.468	28. Feb. 2025	6.226.173
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	15.491.726	22. Apr. 2025	2.563.013
Kauf Long	Banken	Merrill Lynch	EUR	5.997.203	30. Apr. 2025	619.246
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	GBP	7.176.922	28. Feb. 2025	82.630
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	GBP	4.254.904	30. Apr. 2025	75.267
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	5.340.515	15. Mai 2025	899.636
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	7.774.644	07. Aug. 2024	(623.894)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	2.594.576	21. Apr. 2025	(106.952)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	1.300.175	31. Dez. 2024	49.244
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	2.188.355	18. Okt. 2024	185.440
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	4.300.511	18. Jul. 2025	503.478
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	863.572	28. Apr. 2026	(110.925)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	2.556.099	03. Jun. 2024	(46.951)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	1.226.007	20. Jan. 2027	(90.837)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	1.264.613	12. Aug. 2026	442.831	
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	989.645	28. Feb. 2025	(273.329)	
Verkauf Short	Chemie	J.P. Morgan	USD	1.416.186	30. Dez. 2024	131.184	
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	705.409	28. Feb. 2025	(35.871)	
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.038.047	24. Jul. 2024	334.991	
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	695.947	28. Feb. 2025	(6.731)	
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1.665.035	13. Jan. 2027	109.535	
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	USD	1.223.802	17. Mrz. 2025	(94.196)	
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	1.118.669	29. Nov. 2024	(114.284)	
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2.131.689	13. Jan. 2027	120.524	
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	1.006.377	28. Feb. 2025	(85.843)	
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	1.369.479	28. Apr. 2026	33.897	
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	887.523	21. Apr. 2025	(25.881)	
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	713.043	22. Apr. 2025	(27.257)	
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.185.387	28. Mrz. 2025	78.505	
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	294.905	02. Dez. 2026	(118.131)	
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	1.395.287	28. Feb. 2025	106.352	
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	2.663.711	29. Nov. 2024	(337.256)	
Verkauf Short	Haushaltswaren	Morgan Stanley	USD	1.771.148	28. Feb. 2025	(494.155)	
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1.547.054	28. Feb. 2025	(48.914)	
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	USD	1.580.390	15. Mrz. 2027	8.909	
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	1.486.485	28. Feb. 2025	(40.836)	
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Merrill Lynch	USD	1.169.986	31. Dez. 2024	(105.915)	
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Merrill Lynch	USD	904.180	31. Mrz. 2025	(98.017)	
Verkauf Short	Verpackung und Container	Goldman Sachs	CHF	1.008.309	28. Okt. 2026	(52.003)	
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.806.867	07. Apr. 2025	164.707	
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.451.140	28. Feb. 2025	22.891	
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	1.916.124	17. Mrz. 2025	(242.783)	
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1.355.558	28. Feb. 2025	762.319	
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	1.631.840	26. Jan. 2027	(191.940)	
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	2.382.607	09. Dez. 2026	(331.281)	
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.134.799	10. Dez. 2026	(224.288)	
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	CAD	3.752.509	23. Dez. 2024	288.966	
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1.697.757	30. Apr. 2025	43.631	
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	3.319.462	21. Okt. 2024	(331.051)	
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	924.304	30. Apr. 2025	(37.816)	
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	182.980	30. Apr. 2025	(178)	
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	EUR	1.765.734	28. Feb. 2025	(58.711)	
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	USD	29.448.018	28. Feb. 2025	(533.180)	
						EUR	14.316.604
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	39.020.247	09. Sep. 2024	(87.090)	
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	6.592.436	09. Sep. 2024	(169.378)	
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	110.781.380	09. Sep. 2024	(2.412.839)	
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	20.475.664	09. Sep. 2024	(403.560)	
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	177.357.567	09. Sep. 2024	(1.639.030)	
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	56.923.178	09. Sep. 2024	(1.514.562)	
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	20.033.005	09. Sep. 2024	12.096	
						USD	(6.214.363)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	1.930.303	12. Jun. 2025	194.120
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	5.547.140	24. Mai 2024	837.673
Kauf Long	Getränke	Merrill Lynch	USD	2.263.867	24. Dez. 2024	(111.605)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	10.507.783	24. Mai 2024	629.538
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	184.579	12. Jun. 2025	3.441
Kauf Long	Private Equity	Merrill Lynch	USD	2.817.877	24. Apr. 2025	(21.654)
Kauf Long	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	3.794.597	24. Jul. 2024	78.978
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	743.061	09. Apr. 2025	23.376
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	187.453	07. Okt. 2024	(9.506)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	618.753	10. Feb. 2025	19.133
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Merrill Lynch	USD	673.426	15. Okt. 2024	(43.577)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	951.949	30. Apr. 2025	(8.151)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	805.521	24. Mai 2024	(54.691)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	748.846	03. Feb. 2025	(36.436)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	275.127	28. Mrz. 2025	(13.999)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	USD	69.439	05. Feb. 2025	(5.747)
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	1.044.558	21. Jan. 2025	(41.904)
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	198.143	24. Feb. 2025	5.399
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	73.505	07. Apr. 2025	(2.296)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.655.212	24. Mai 2024	(55.647)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	2.400.243	28. Okt. 2024	(17.121)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	871.681	12. Sep. 2024	(20.058)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	343.474	22. Apr. 2024	(791)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	464.520	29. Apr. 2024	(4.475)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	1.034.246	11. Okt. 2024	10.444
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	723.151	18. Nov. 2024	49.143
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	356.344	11. Feb. 2025	(6.328)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Merrill Lynch	USD	110.392	24. Apr. 2025	(2.506)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	715.045	12. Jun. 2024	(77.557)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	740.589	12. Mrz. 2025	10.981
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.719.275	24. Jun. 2024	(183.688)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	189.720	28. Apr. 2025	(5.082)
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Goldman Sachs	USD	94.584	23. Apr. 2025	(4.334)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	185.688	12. Sep. 2024	8.606
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	790.529	03. Feb. 2025	(90.207)
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	790.859	12. Jun. 2025	(263.568)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	4.805.315	12. Jun. 2024	(126.129)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1.712.758	12. Dez. 2024	(27.561)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3.217.059	12. Jun. 2025	(230.434)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	11.346.829	29. Mai 2024	(218.754)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	89.006	05. Feb. 2025	(9.722)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	843.355	24. Sep. 2024	(176.130)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	1.136.984	21. Jan. 2025	(91.541)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	688.719	14. Mai 2024	(62.792)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	532.205	24. Dez. 2024	(66.931)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	591.653	10. Apr. 2024	(20.866)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	336.349	24. Jun. 2024	26.152
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	442.226	24. Jul. 2024	32.187

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	548.175	15. Jan. 2025	47.803	
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	497.974	26. Mrz. 2025	17.468	
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.088.169	12. Dez. 2024	(118.439)	
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	871.598	16. Jan. 2025	134.088	
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	241.082	26. Jul. 2024	(9.570)	
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	664.858	24. Dez. 2024	3.646	
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	319.729	03. Feb. 2025	(67.783)	
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	915.749	28. Feb. 2025	(78.881)	
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	188.581	28. Apr. 2025	(699)	
Verkauf Short	Freizeit	Merrill Lynch	USD	817.330	12. Nov. 2024	(80.546)	
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Merrill Lynch	USD	56.576	22. Jan. 2025	553	
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	1.052.789	12. Dez. 2024	51.731	
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	637.415	09. Apr. 2025	(62.406)	
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	513.494	14. Mai 2024	(14.118)	
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	145.144	24. Sep. 2024	(10.659)	
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	183.549	28. Jan. 2025	(35.597)	
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	718.634	24. Dez. 2024	(22.103)	
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	735.210	24. Apr. 2025	(89.460)	
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	73.797	09. Apr. 2025	(2.610)	
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	248.033	18. Sep. 2024	5.050	
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	265.511	12. Sep. 2024	(21.452)	
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	96.785	01. Jul. 2024	(1.580)	
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	744.057	18. Sep. 2024	32.443	
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	810.398	12. Nov. 2024	(46.029)	
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	663.775	10. Feb. 2025	33.966	
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	857.009	14. Apr. 2025	(34.390)	
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	368.490	24. Mai 2024	(2.974)	
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	638.110	18. Okt. 2024	(50.253)	
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	184.128	07. Mrz. 2025	(23.641)	
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	692.225	16. Mai 2024	(5.057)	
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	255.107	12. Dez. 2024	33.324	
Verkauf Short	Telekommunikation	Merrill Lynch	USD	743.686	02. Dez. 2024	40.311	
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	562.977	05. Nov. 2024	(10.712)	
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	756.259	16. Mai 2024	(255)	
						USD	(571.448)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	330.780.411	18. Okt. 2024	4.972.679	
						USD	4.972.679
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Werbung	Goldman Sachs	USD	115.393	18. Jul. 2025	(632)	
Kauf Long	Werbung	Morgan Stanley	USD	83.987	19. Mai 2025	623	
Kauf Long	Werbung	Morgan Stanley	USD	240.059	18. Mai 2033	11.614	
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	104.210	05. Mai 2028	5.649	
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	39.059	24. Mai 2033	491	
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	132.699	18. Mai 2033	2.709	
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	290.967	18. Mai 2033	16.344	
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	261.707	24. Mai 2033	12.191	
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	125.553	24. Mai 2033	1.884	

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	222.806	24. Mai 2033	6.601
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	2.035.353	24. Mai 2033	41.157
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	1.142.240	24. Mai 2033	35.136
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	84.302	24. Mai 2033	4.360
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	1.706.428	24. Mai 2033	21.254
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	1.449.379	24. Mai 2033	83.068
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	135.069	05. Mai 2028	3.759
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	343.653	05. Mai 2028	29.260
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	102.449	05. Mai 2028	11.736
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	169.847	05. Mai 2028	12.602
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	108	05. Mai 2028	9
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	223.656	08. Mai 2028	12.096
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	219.117	08. Mai 2028	16.774
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	284.238	08. Mai 2028	15.646
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	1.448.986	05. Mai 2028	81.773
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	139.485	18. Mai 2033	761
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	148.568	18. Mai 2033	8.171
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	147.814	18. Mai 2033	9.889
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	2.265	18. Mai 2033	7
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	330.091	18. Mai 2033	(2.001)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	255.089	18. Mai 2033	2.127
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	606.888	18. Mai 2033	17.349
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	61.848	18. Mai 2033	3.250
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	752.963	18. Mai 2033	73.584
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	616.001	18. Mai 2033	56.413
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	3.397.806	18. Mai 2033	26.587
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	146.864	18. Mai 2033	12.169
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	133.770	18. Mai 2033	3.687
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	84.549	24. Mai 2033	3.135
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	104.626	08. Feb. 2029	3.532
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	101.816	15. Mrz. 2029	3.404
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	69.835	24. Mai 2033	(2.068)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	127.218	24. Mai 2033	(1.811)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.392	24. Mai 2033	(26)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	16.208	24. Mai 2033	413
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	197.923	24. Mai 2033	7.060
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	12.174	24. Mai 2033	(206)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	213.462	05. Mai 2028	(197)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	172.246	18. Mai 2033	3.255
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	238.344	18. Mai 2033	17.895
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	366.106	18. Mai 2033	9.267
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	16.753	18. Mai 2033	(15)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	159.296	18. Mai 2033	4.163
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	286.830	18. Mai 2033	14.942
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	75.306	18. Mai 2033	3.783
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	77.161	18. Mai 2033	2.014
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	249.161	18. Mai 2033	(237)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	94.369	18. Mai 2033	6.186

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	98.528	18. Mai 2033	(923)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	54.618	18. Mai 2033	(3.364)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	6.771	18. Mai 2033	473
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	54.554	18. Mai 2033	(1.129)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	97.749	24. Mai 2033	8.024
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	254.188	24. Mai 2033	1.901
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	42.115	24. Mai 2033	1.613
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	309.298	24. Mai 2033	(421)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	175.836	05. Mai 2028	18.620
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	4.767	05. Mai 2028	179
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	472.335	18. Mai 2033	13.653
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	383.052	18. Mai 2033	21.071
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.645.577	18. Mai 2033	10.275
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	137.518	24. Mai 2033	(3.255)
Kauf Long	Computer	J.P. Morgan	USD	20.636	05. Mai 2028	(1.373)
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	19.403	18. Mai 2033	(140)
Kauf Long	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	USD	70.776	18. Mai 2033	(1.186)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	496.616	24. Mai 2033	(479)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	399.288	24. Mai 2033	914
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	74.093	24. Mai 2033	(289)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	209.880	24. Mai 2033	4.560
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	6.758	05. Mai 2028	1.048
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	99.870	05. Mai 2028	7.350
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	192.344	18. Mai 2033	14.384
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	128.676	18. Mai 2033	4.368
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	499.174	18. Mai 2033	(96)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	141.512	05. Mai 2028	2.842
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	10.383	24. Mai 2033	575
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	156.491	18. Mai 2033	(5.575)
Kauf Long	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	86.867	24. Mai 2033	5.562
Kauf Long	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	76.226	05. Mai 2028	3.500
Kauf Long	Unterhaltung	Goldman Sachs	GBP	361.926	13. Nov. 2028	11.479
Kauf Long	Unterhaltung	J.P. Morgan	GBP	174.120	05. Mai 2028	3.413
Kauf Long	Unterhaltung	J.P. Morgan	USD	19.177	16. Mai 2033	1.475
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	447.024	18. Mai 2033	14.836
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	103.666	18. Mai 2033	1.998
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	289.680	18. Mai 2033	17.246
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	382.965	18. Mai 2033	44.681
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	520.084	18. Mai 2033	38.989
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	106.466	18. Mai 2033	8.591
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	361.429	18. Mai 2033	3.920
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	273.167	24. Mai 2033	(1.359)
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	549.246	18. Mai 2033	8.380
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	540.793	18. Mai 2033	11.657
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	900.932	18. Mai 2033	1.523
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	GBP	524.163	18. Mai 2033	4.788
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	705.890	18. Mai 2033	1.985
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	459.704	18. Mai 2033	(6.988)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	947.630	18. Mai 2033	35.602
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	141.375	24. Mai 2033	5.501
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	208.224	24. Mai 2033	5.640
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	57.647	24. Mai 2033	5.888
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	403.715	24. Mai 2033	807
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	17.276	24. Mai 2033	(28)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	5.183	24. Mai 2033	130
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	28.251	24. Mai 2033	2.464
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	86.766	25. Mai 2033	(5.193)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	102.292	22. Apr. 2025	4.661
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	930.707	05. Mai 2028	20.414
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	87.258	05. Mai 2028	4.969
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	301.646	05. Mai 2028	4.691
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	238.177	18. Mai 2033	306
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	79.252	18. Mai 2033	1.269
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	339.216	18. Mai 2033	2.405
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	441.983	18. Mai 2033	14.231
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	557.163	18. Mai 2033	9.433
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	208.466	24. Mai 2033	(2.640)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	187.674	24. Mai 2033	(792)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	28.940	24. Mai 2033	411
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	22.678	24. Mai 2033	470
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	23.316	24. Mai 2033	1.383
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	26.528	24. Mai 2033	2.045
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	53.729	05. Mai 2028	1.399
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	398.148	05. Mai 2028	4.255
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	301.606	05. Mai 2028	414
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	229.786	05. Mai 2028	23.900
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	55.923	18. Mai 2033	2.230
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	119.451	18. Mai 2033	4.289
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	102.161	18. Mai 2033	(3.407)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	6.985	18. Mai 2033	1.024
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	89.401	18. Mai 2033	9.365
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	259.887	18. Mai 2033	28.886
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	23.406	08. Mai 2028	(36)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	144.950	18. Mai 2033	(5.701)
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	DKK	73.132	24. Mai 2033	198
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	109.025	24. Mai 2033	2.645
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	1.325.705	05. Mai 2028	100.855
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	155.222	05. Mai 2028	14.665
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	13.854	05. Mai 2028	1.380
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	332.538	05. Mai 2028	4.514
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	JPY	122.013	08. Mai 2028	(2.966)
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	DKK	125.617	18. Mai 2033	254
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	GBP	66.569	18. Mai 2033	1.942
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	NOK	379.979	19. Mai 2033	7.526
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	EUR	412.815	24. Mai 2033	(5.129)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	HKD	178.937	08. Apr. 2024	(2.510)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	HKD	64.613	08. Apr. 2024	3.354
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	479.738	24. Mai 2033	(18.923)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	46.390	24. Mai 2033	345
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	EUR	17.255	20. Mai 2033	496
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	GBP	45.937	05. Mai 2028	671
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	HKD	91.471	22. Jul. 2025	722
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	323.628	05. Mai 2028	(2.792)
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	204.967	05. Mai 2028	825
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	88.679	18. Mai 2033	(2.033)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	PLN	194.396	18. Mai 2033	6.147
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	108.827	28. Feb. 2025	(4.701)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	203.354	28. Feb. 2025	7.548
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	1.512.570	24. Jun. 2025	51.685
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	360.691	18. Mai 2033	(8.439)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	448.353	18. Mai 2033	3.723
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	156.160	18. Mai 2033	5.008
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	735.832	18. Mai 2033	2.250
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	272.602	18. Mai 2033	9.507
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	397.254	18. Mai 2033	5.577
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	380.426	18. Mai 2033	4.601
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	452.046	18. Mai 2033	53.923
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	435.254	18. Mai 2033	23.905
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	95.765	18. Mai 2033	3.986
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	214.019	18. Mai 2033	(2.025)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	381.547	18. Mai 2033	43.382
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	55.394	18. Mai 2033	14
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	45.460	18. Mai 2033	3.140
Kauf Long	Freizeit	Morgan Stanley	USD	453.283	18. Mai 2033	35.476
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	HKD	35.613	05. Mai 2028	3.172
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	USD	74.594	05. Mai 2028	3.477
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	545.554	28. Feb. 2025	(10.453)
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	653.399	18. Mai 2033	20.705
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	262.349	18. Mai 2033	10.282
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	442.884	18. Mai 2033	18.719
Kauf Long	Medien	J.P. Morgan	USD	38.364	15. Mai 2033	3.973
Kauf Long	Medien	J.P. Morgan	USD	171.110	15. Mai 2033	9.005
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	744.356	18. Mai 2033	69.216
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	67.959	18. Mai 2033	1.785
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	34.278	18. Mai 2033	1.995
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	138.831	18. Mai 2033	3.997
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	59.365	18. Mai 2033	(3.015)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	444.103	05. Mai 2028	(10.755)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	1.507.421	05. Mai 2028	114.665
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	353.405	05. Mai 2028	25.188
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	172.415	05. Mai 2028	540
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	78.243	18. Mai 2033	2.121
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	445.789	18. Mai 2033	19.316
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	492.913	18. Mai 2033	36.181
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	84.992	24. Mai 2033	2.250

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	196.891	24. Mai 2033	12.263
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	309.199	05. Apr. 2024	11.561
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	199.608	12. Sep. 2028	(5.308)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	496.178	12. Sep. 2028	(11.630)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	57.966	24. Mai 2033	(603)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	98.569	24. Mai 2033	609
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	144.166	05. Mai 2028	(4.935)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	277.778	05. Mai 2028	17.787
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	362.680	05. Mai 2028	(15.939)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	538.792	18. Mai 2033	(3.887)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	10.228	18. Mai 2033	971
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	4.356	18. Mai 2033	(52)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	14.467	18. Mai 2033	(53)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	389.906	18. Mai 2033	12.299
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	370.209	18. Mai 2033	7.397
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	627.904	18. Mai 2033	39.659
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	178.693	18. Mai 2033	3.362
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	235.218	18. Mai 2033	(9.900)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	264.411	05. Mai 2028	9.736
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	293.266	05. Mai 2028	13.863
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	442.720	05. Mai 2028	17.266
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	158.433	05. Mai 2028	5.630
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	68.736	18. Mai 2033	1.296
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	135.895	18. Mai 2033	7.642
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	171.989	18. Mai 2033	9.770
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	GBP	264.855	05. Mai 2028	13.352
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	67.337	05. Mai 2028	2.767
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	236.432	18. Mai 2033	9.487
Kauf Long	Immobilien	Goldman Sachs	SEK	124.633	24. Mai 2033	7.192
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	USD	232.786	18. Mai 2033	(4.978)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	194.241	24. Mai 2033	2.954
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	127.714	24. Mai 2033	5.061
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	57.459	05. Mai 2028	(2.956)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	352.882	05. Mai 2028	(9.629)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	355.387	18. Mai 2033	202
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	66.583	18. Mai 2033	377
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	215.398	18. Mai 2033	(958)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	123.658	18. Mai 2033	9.781
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	652.031	18. Mai 2033	26.768
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	456.548	18. Mai 2033	5.159
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1.417.925	18. Mai 2033	(12.654)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	389.039	18. Mai 2033	42.749
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	317.241	18. Mai 2033	14.131
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	193.663	18. Mai 2033	(12.792)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	641.008	18. Mai 2033	41.630
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	40.398	18. Mai 2033	301
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	206.483	18. Mai 2033	11.913
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	321.305	18. Mai 2033	13.218
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	165.858	24. Mai 2033	43.659

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	20.650	05. Mai 2028	(465)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	102.962	15. Mai 2033	4.396
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	468.881	27. Jan. 2026	4.315
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	45.040	18. Mai 2033	11.901
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	81.726	18. Mai 2033	987
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	32.496	18. Mai 2033	3.192
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	58.293	18. Mai 2033	1.876
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	146.044	18. Mai 2033	(249)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	EUR	48.794	24. Mai 2033	1.446
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	138.242	08. Jan. 2029	(166)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	58.682	24. Mai 2033	(622)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	55.264	24. Mai 2033	(372)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	216.637	24. Mai 2033	281
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	28.993	05. Mai 2028	153
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	54.331	05. Mai 2028	(7.035)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	73.455	16. Mai 2033	(1.946)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	353.887	18. Mai 2033	7.835
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	153.697	18. Mai 2033	6.613
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	173.612	18. Mai 2033	(1.273)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	466.807	18. Mai 2033	10.864
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	55.384	18. Mai 2033	572
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	94.055	18. Mai 2033	3.671
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	195.648	18. Mai 2033	4.863
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	53.386	18. Mai 2033	892
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	113.285	18. Mai 2033	1.480
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	23.451	18. Mai 2033	(195)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	100.912	18. Mai 2033	2.665
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	40.271	18. Mai 2033	2.519
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	48.060	18. Mai 2033	905
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	181.829	24. Mai 2033	2.248
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	25.230	05. Mai 2028	466
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	CAD	28.735	18. Mai 2033	(1.071)
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	SGD	130.358	18. Mai 2033	432
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	382.875	18. Mai 2033	12.351
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	436.514	18. Mai 2033	(12.764)
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	13.416.009	25. Mai 2033	48.263
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	34.210	25. Mai 2033	13
Verkauf Short	Werbung	J.P. Morgan	USD	79.662	15. Mai 2033	(1.064)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	USD	174.258	19. Mai 2025	(1.291)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	USD	64.291	19. Mai 2025	(8.967)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	USD	258.236	18. Mai 2033	(12.596)
Verkauf Short	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	169.093	18. Mai 2033	(7.784)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	EUR	27.303	24. Mai 2033	640
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	128.272	05. Mai 2028	15.111
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	252.924	18. Mai 2033	(8.746)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	532.958	18. Mai 2033	23.868
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	54.806	18. Jul. 2025	(41)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	HKD	112.026	05. Mai 2028	17.429

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	817.850	18. Mai 2033	(61.100)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CAD	1.048.641	25. Mai 2033	(21.264)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	128.090	24. Mai 2033	243
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	172.885	24. Mai 2033	(7.191)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	106.193	24. Mai 2033	(4.473)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	359.034	24. Mai 2033	(1.070)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	ILS	147.689	25. Mai 2033	(2.554)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	123.940	24. Mai 2033	2.799
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	435.315	24. Mai 2033	(24.133)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	129.307	24. Mai 2033	(87)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	409.260	24. Mai 2033	45.957
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	1.079.080	24. Mai 2033	(17.685)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	2.152.725	24. Mai 2033	(109.029)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	1.063.468	24. Mai 2033	(68.316)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	1.160.171	24. Mai 2033	(30.373)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	DKK	126.038	05. Mai 2028	(5.353)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	792.146	05. Mai 2028	(64.428)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	141.489	05. Mai 2028	(12.351)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	1.020.084	05. Mai 2028	(100.408)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	816.443	05. Mai 2028	(25.693)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	128.206	05. Mai 2028	(10.481)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	310.862	05. Mai 2028	(19.348)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	NOK	102.869	05. Mai 2028	(792)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	1.742.736	22. Mai 2024	169.767
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	552.531	05. Mai 2028	28.271
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	323.643	05. Mai 2028	23.583
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	476.137	05. Mai 2028	(34.039)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	109.666	05. Mai 2028	(1.220)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	796.477	05. Mai 2028	(32.692)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	2.269.204	18. Mai 2033	(84.791)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CHF	260.867	18. Mai 2033	(1.476)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	DKK	147.477	18. Mai 2033	(2.604)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	139.504	18. Mai 2033	(8.453)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	163.719	18. Mai 2033	288
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	1.151.416	18. Mai 2033	(22.997)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	118.858	18. Mai 2033	1.371
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	134.396	18. Mai 2033	551
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	382.421	18. Mai 2033	12.165
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	NOK	490.250	19. Mai 2033	(16.412)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	95.443	18. Mai 2033	5.943
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	146.515	18. Mai 2033	10.059
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	394.360	18. Mai 2033	38.618
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	2.411.227	18. Mai 2033	(134.793)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	560.454	18. Mai 2033	(48.293)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	505.687	18. Mai 2033	(29.834)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	USD	140.066	24. Mai 2033	(2.567)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	USD	253.906	18. Mai 2033	(15.960)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	USD	174.519	18. Mai 2033	3.378

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	161.889	15. Mrz. 2029	(2.017)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	100.356	24. Mai 2033	(3.055)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	185.727	24. Mai 2033	4.050
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	54.811	24. Mai 2033	(785)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	2.019	24. Mai 2033	(15)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	27.027	24. Mai 2033	737
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	84.900	24. Mai 2033	(9.960)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	175.505	05. Mai 2028	27.803
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	52.377	05. Mai 2028	(279)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	10.328	05. Mai 2028	325
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	207.110	18. Mai 2033	(7.676)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	112.930	18. Mai 2033	(2.859)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	96.144	18. Mai 2033	424
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	60.299	18. Mai 2033	318
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	94.669	18. Mai 2033	3.936
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	61.272	18. Mai 2033	(7.728)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	144.088	18. Mai 2033	5.433
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	179.077	18. Mai 2033	(10.149)
Verkauf Short	Kohle	J.P. Morgan	USD	44.135	05. Mai 2028	(2.562)
Verkauf Short	Kohle	J.P. Morgan	USD	79.132	05. Mai 2028	5.926
Verkauf Short	Kohle	Morgan Stanley	USD	1.134	18. Mai 2033	(39)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	961	28. Mai 2025	7
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	613.289	09. Sep. 2025	(7.188)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	726.571	24. Mai 2033	(5.251)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	235.839	24. Mai 2033	(2.522)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	149.575	24. Mai 2033	1.782
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	67.486	05. Mai 2028	(378)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	198.518	05. Mai 2028	(5.465)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	392.338	05. Mai 2028	(10.279)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	62.964	05. Mai 2028	(2.372)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	206.239	19. Mai 2025	(11.789)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	452.466	18. Mai 2033	(14.298)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	317.316	18. Mai 2033	(7.327)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	215.233	18. Mai 2033	(2.605)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	25.559	18. Mai 2033	(94)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	201.971	18. Mai 2033	(6.773)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	278.603	18. Mai 2033	47.019
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	150.195	18. Mai 2033	4.635
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	101.093	18. Mai 2033	(340)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	299.109	18. Mai 2033	(17.400)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	101.663	13. Jan. 2027	4.091
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	33.756	20. Feb. 2026	(262)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	200.241	18. Mai 2033	115
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	932.148	18. Mai 2033	6.156
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	372.823	18. Mai 2033	17.201
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	289.566	18. Mai 2033	(6.763)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	49.807	24. Mai 2033	(215)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	EUR	78.413	05. Mai 2028	(53)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	67.506	18. Mai 2033	1.125
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	USD	171.753	18. Mai 2033	(21.351)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	35.393	24. Mai 2033	(1.813)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	57.998	12. Mrz. 2025	(307)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	118.635	24. Mai 2033	(6.079)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	48.689	24. Mai 2033	460
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	268.608	18. Jul. 2025	(5.308)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	377.057	24. Mai 2033	(17.578)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	930.742	24. Mai 2033	(7.276)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	487.951	24. Mai 2033	(24.598)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	637.073	24. Mai 2033	10.538
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	128.149	24. Mai 2033	(5.698)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	144.179	24. Mai 2033	243
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	283.622	24. Mai 2033	(6.973)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	69.489	24. Mai 2033	(433)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	221.736	05. Mai 2028	(16.361)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	244.711	05. Mai 2028	(6.634)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	334.043	08. Mai 2028	648
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SEK	131.822	05. Mai 2028	(2.836)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	411.973	05. Mai 2028	(23.500)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	96.706	05. Mai 2028	(4.440)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	40.810	05. Mai 2028	(1.134)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	AUD	520.687	18. Mai 2033	8.577
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	177.540	18. Mai 2033	(6.016)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	333.650	18. Mai 2033	(10.308)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SEK	295.578	18. Mai 2033	3.332
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.927.813	18. Mai 2033	(122.284)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	362.904	18. Mai 2033	140
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	51.848	18. Mai 2033	(4.820)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	455.238	18. Mai 2033	(3.699)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	542.871	18. Mai 2033	7.595
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	121.094	18. Mai 2033	(7.565)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	601.072	18. Mai 2033	(11.106)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	176.735	18. Mai 2033	(15.826)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	712.949	18. Mai 2033	(19.165)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	262.004	24. Mai 2033	(2.465)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	53.572	05. Mai 2028	(1.096)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	233.879	05. Mai 2028	(4.102)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	176.974	05. Mai 2028	(3.459)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	134.398	05. Mai 2028	(386)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	38.341	05. Mai 2028	(2.121)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	185.255	05. Mai 2028	(8.406)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	90.507	05. Mai 2028	(5.445)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	101.227	05. Mai 2028	(3.983)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	184.035	18. Mai 2033	(6.004)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	92.810	18. Mai 2033	(1.268)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	215.057	18. Mai 2033	(4.522)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	73.350	18. Mai 2033	(2.618)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	21.462	18. Mai 2033	(518)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	224.904	18. Mai 2033	(11.492)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	46.176	18. Mai 2033	(3.072)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	29.780	18. Mai 2033	(997)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	38.115	18. Mai 2033	(1.423)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	44.244	18. Mai 2033	(990)
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Goldman Sachs	EUR	356.454	24. Mai 2033	(663)
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	J.P. Morgan	EUR	15.832	05. Mai 2028	537
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	EUR	279.757	24. Mai 2033	(4.054)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	383.377	24. Mai 2033	18.847
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	158.244	12. Sep. 2024	(8.791)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	152.435	18. Jul. 2025	(3.326)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	414	08. Mai 2028	(8)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	EUR	65.055	18. Mai 2033	(1.139)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	14.131	18. Mai 2033	95
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	216.595	18. Mai 2033	(405)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	DKK	149.303	14. Apr. 2028	92
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	8.233	24. Mai 2033	187
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	1.475	05. Mai 2028	81
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	16.647	05. Mai 2028	871
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	2.434	05. Mai 2028	-
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	46.062	05. Mai 2028	(7.301)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	52.432	05. Mai 2028	(2.946)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	6.790	18. Mai 2033	29
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	24.309	18. Mai 2033	(803)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	8.413	18. Mai 2033	(3.124)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	85.576	24. Mai 2033	(1.735)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	1.101	05. Mai 2028	(7)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	91.190	18. Mai 2033	40
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	SEK	222.826	07. Apr. 2027	4.489
Verkauf Short	Unterhaltung	J.P. Morgan	SEK	124.259	20. Mai 2033	(1.377)
Verkauf Short	Unterhaltung	J.P. Morgan	USD	132.841	05. Mai 2028	(2.743)
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	230.438	18. Mai 2033	(10.503)
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	192.453	18. Mai 2033	(1.409)
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	70.847	18. Mai 2033	944
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	313.373	18. Mai 2033	(14.850)
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	326.361	18. Mai 2033	(28.252)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	381.593	24. Mai 2033	(6.117)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	424.726	24. Mai 2033	3.200
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1.346.574	24. Mai 2033	3.345
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	386.953	26. Mai 2033	(359)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	988.108	05. Mai 2028	(26.154)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	901.632	05. Mai 2028	(13.755)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	431.579	15. Mai 2033	(40.816)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	61.698	20. Mai 2033	(1.575)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	347.943	18. Mai 2033	(2.969)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	352.547	18. Mai 2033	(5.688)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	595.688	18. Mai 2033	(36.188)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	406.590	18. Mai 2033	(879)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	1.209.358	18. Mai 2033	(26.006)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	179.488	18. Mai 2033	(7.883)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	99.392	18. Mai 2033	(2.009)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	2.093.773	18. Mai 2033	(87.528)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	250.899	18. Mai 2033	(10.671)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	770.749	18. Mai 2033	(23.895)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	87.242	18. Mai 2033	(1.875)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	1.005.927	18. Mai 2033	(35.358)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	5.304.418	18. Mai 2033	(268.245)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	1.004.861	18. Mai 2033	(3.298)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	CHF	194.822	05. Mai 2028	(1.863)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	181.598	28. Feb. 2025	6.001
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	318.687	18. Mai 2033	(2.238)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	226.933	18. Mai 2033	(3.791)
Verkauf Short	Gas	J.P. Morgan	USD	561.347	05. Mai 2028	(40.801)
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	USD	183.535	18. Mai 2033	(7.243)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	359.420	05. Apr. 2024	9.227
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	194.006	24. Mai 2033	(2.058)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	142.695	24. Mai 2033	(207)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	132.401	24. Mai 2033	44.320
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	99.982	24. Mai 2033	(5.243)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	296.007	24. Mai 2033	(933)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	151.967	24. Mai 2033	(2.993)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	111.813	24. Mai 2033	(4.387)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	44.918	24. Mai 2033	1.508
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	138.329	24. Mai 2033	(565)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	109.850	24. Mai 2033	(2.759)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	304.777	24. Mai 2033	600
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	AUD	140.128	05. Mai 2028	(2.513)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	147.715	05. Mai 2028	5.328
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	HKD	52	05. Mai 2028	17
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	JPY	189.587	08. Mai 2028	(2.177)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	2.020	05. Mai 2028	2.013
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1.616	05. Mai 2028	1.609
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	25.136	18. Mai 2033	8.331
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	444.303	18. Mai 2033	(17.701)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	161.324	18. Mai 2033	(3.701)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	150.632	18. Mai 2033	(2.112)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	49.592	18. Mai 2033	(1.656)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	213.869	18. Mai 2033	(3.588)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	238.070	24. Mai 2033	1.254
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	90.770	24. Mai 2033	(5.061)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	248.415	24. Mai 2033	(10.484)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	178.221	24. Mai 2033	(1.550)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	121.372	05. Mai 2028	8.742
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	45.798	05. Mai 2028	(3.717)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	526.650	18. Mai 2033	(24.420)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	15.706	18. Mai 2033	(1.163)
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	106.139	18. Mai 2033	(24.570)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	368.007	18. Mai 2033	106

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	179.545	24. Mai 2033	(1.712)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	201.958	24. Mai 2033	(8.816)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	1.445.674	05. Mai 2028	(12.255)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	270.125	05. Mai 2028	6.837
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	662.236	05. Mai 2028	(52.196)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	955.668	05. Mai 2028	(55.118)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	130.253	05. Mai 2028	(10.730)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	232.030	05. Mai 2028	10.846
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	JPY	405.382	20. Feb. 2025	8.424
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	CHF	363.905	18. Mai 2033	840
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	551.758	18. Mai 2033	(7.973)
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	311.543	18. Mai 2033	(21.774)
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	274.612	18. Mai 2033	9.858
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	NOK	304.453	19. Mai 2033	19.195
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	EUR	277.506	24. Mai 2033	(14.364)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	GBP	170.362	24. Mai 2033	9.562
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	165.794	24. Mai 2033	(508)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	GBP	198.037	05. Mai 2028	(1.986)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	GBP	32.578	20. Mai 2033	2.352
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	HKD	128.301	22. Jul. 2024	(8.792)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	HKD	180.865	24. Feb. 2026	(13.141)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	128.748	05. Mai 2028	(18.335)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	65.062	16. Mai 2033	(856)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	34.415	16. Mai 2033	(1.216)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	HKD	200.110	18. Mai 2033	(14.090)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	714.527	19. Mai 2025	(19.215)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	403.258	19. Mai 2025	(14.972)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	353.358	18. Mai 2033	(4.701)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	272.633	18. Mai 2033	(3.728)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	275.106	18. Mai 2033	(1.921)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	259.545	18. Mai 2033	(3.990)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	587.205	18. Mai 2033	(36.791)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	395.334	18. Mai 2033	(13.975)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	109.529	18. Mai 2033	(1.169)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	226.543	18. Mai 2033	(1.425)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	67.956	18. Mai 2033	(3.934)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	340.699	18. Mai 2033	3.259
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	281.101	18. Mai 2033	(31.961)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	372.793	18. Mai 2033	(478)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	68.405	18. Mai 2033	(1.261)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	361.992	18. Mai 2033	(37.408)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	190.533	18. Mai 2033	(1.217)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	279.160	18. Mai 2033	(25.505)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	122.524	18. Mai 2033	(4.961)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	GBP	260.966	22. Dez. 2033	(9.854)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	GBP	121	20. Mai 2033	(5)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	USD	145.052	15. Mai 2033	128
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	327.128	18. Mai 2033	7.083
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	261.546	18. Mai 2033	(23.823)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	268.477	18. Mai 2033	(9.064)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	378.287	18. Mai 2033	(38.199)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	260.967	18. Mai 2033	(3.426)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	USD	95.317	05. Mai 2028	(21.612)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	545.880	24. Mai 2033	2.643
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	68.325	15. Mai 2033	(1.717)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	354.884	19. Mai 2025	24
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	696.318	18. Mai 2033	(8.727)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	254.910	18. Mai 2033	(23.704)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	177.700	18. Mai 2033	(3.954)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	SEK	491.822	18. Mai 2033	569
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	AUD	345.438	24. Mai 2033	(11.894)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	CAD	8.013	25. Mai 2033	(111)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	CAD	43.438	25. Mai 2033	(2.251)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	27.543	24. Mai 2033	(142)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	121.157	24. Mai 2033	196
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	88.443	24. Mai 2033	(6.594)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	31.015	24. Mai 2033	(34)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	115.199	24. Mai 2033	(5.047)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	USD	133.652	11. Dez. 2028	(3.455)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	AUD	247	05. Mai 2028	(18)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	CAD	634.574	05. Mai 2028	(54.622)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	EUR	58.887	05. Mai 2028	(3.904)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	NOK	11.480	05. Mai 2028	(432)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	251.122	05. Mai 2028	(15.012)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	180.174	05. Mai 2028	(2.472)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	139.335	05. Mai 2028	(15.249)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	18.743	05. Mai 2028	(2.046)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	71.929	05. Mai 2028	(4.909)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	520.632	05. Mai 2028	(54.523)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	887.488	05. Mai 2028	(90.274)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	65.938	05. Mai 2028	(13.863)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	98.977	05. Mai 2028	(10.264)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	46.561	05. Mai 2028	(2.189)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	16.939	05. Mai 2028	(1.135)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	186.431	05. Mai 2028	(27.039)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	170.463	05. Mai 2028	(21.711)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	92.494	05. Mai 2028	(7.539)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	104.629	05. Mai 2028	2.298
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	508.257	05. Mai 2028	(56.709)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	119.603	05. Mai 2028	(861)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	4.235	05. Mai 2028	(568)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	AUD	10.054	18. Mai 2033	(558)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	267.132	18. Mai 2033	(10.922)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	69.326	18. Mai 2033	(523)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	763.143	18. Mai 2033	(22.065)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	437.367	18. Mai 2033	(13.637)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	445.280	18. Mai 2033	(41.961)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	434.695	18. Mai 2033	(23.570)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	97.234	18. Mai 2033	1.284
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	151.438	18. Mai 2033	(7.402)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	75.014	18. Mai 2033	(5.162)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	GBP	10.607	18. Mai 2033	(302)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	NOK	227.515	19. Mai 2033	(3.443)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	25.550	18. Mai 2033	(886)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	48.989	18. Mai 2033	(3.204)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	63.647	18. Mai 2033	(2.748)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	103.514	18. Mai 2033	(4.982)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	14.037	18. Mai 2033	94
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	70.423	18. Mai 2033	(6.407)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	196.631	18. Mai 2033	(16.526)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	85.729	18. Mai 2033	(7.509)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	115.397	18. Mai 2033	(12.810)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	42.834	18. Mai 2033	(1.800)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	24.998	18. Mai 2033	968
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	169.570	18. Mai 2033	(5.808)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	186.594	18. Mai 2033	(12.232)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	14.657	18. Mai 2033	(254)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	798	18. Mai 2033	(22)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	389.655	18. Mai 2033	(17.780)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	427.261	24. Mai 2033	(13.415)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	72.040	24. Mai 2033	(3.759)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	116.111	05. Mai 2028	5.781
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	102.283	05. Mai 2028	(4.699)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.275	05. Mai 2028	32
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	70.713	05. Mai 2028	(8.276)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	205.213	18. Mai 2033	(9.192)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	115.041	18. Mai 2033	(1.633)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	175	18. Mai 2033	(6)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	52.801	24. Mai 2033	(3.800)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	220.404	24. Mai 2033	(1.636)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	119.943	24. Mai 2033	(4.020)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	128.864	24. Mai 2033	2.540
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	72.640	24. Mai 2033	140
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	21.586	24. Mai 2033	(109)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	528.222	20. Jun. 2024	(17.967)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	56.394	05. Mai 2028	(5.319)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	132.161	08. Mai 2028	10.022
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	475.843	18. Mai 2033	(17.184)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	85.103	18. Mai 2033	(7.057)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	17.474	18. Mai 2033	(542)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	133.646	18. Mai 2033	14.400
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	247.710	18. Mai 2033	(16)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	562.775	18. Mai 2033	(17.400)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	132.051	18. Mai 2033	853
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	133.779	18. Mai 2033	(2.149)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	611.159	18. Mai 2033	(19.339)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	71.315	18. Mai 2033	(3.568)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	176.621	18. Mai 2033	(5.024)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	154.713	18. Mai 2033	(1.651)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	197.913	18. Mai 2033	1.367
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	114.707	24. Mai 2033	(1.972)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	210.056	05. Mai 2028	(11.481)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	324.347	05. Mai 2028	(11.348)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	269.176	05. Mai 2028	(38.581)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	55.174	05. Mai 2028	(2.749)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	CAD	92.561	18. Mai 2033	(3.639)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	1.182	18. Mai 2033	(47)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	113.344	18. Mai 2033	(4.766)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	60.047	24. Mai 2033	(1.697)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	704.512	24. Mai 2033	(8.051)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	CHF	378.037	05. Mai 2028	(3.499)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	SEK	587.564	05. Mai 2028	(72.027)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	582.036	05. Mai 2028	(10.484)
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	CHF	134.933	18. Mai 2033	(206)
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	SEK	242.285	18. Mai 2033	1.935
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	1.568.873	18. Mai 2033	(80.346)
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	951.649	18. Mai 2033	(49.739)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	114.310	24. Mai 2033	(3.781)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	GBP	322	24. Mai 2033	(18)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	114.660	05. Mai 2028	(9.127)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	267.481	05. Mai 2028	(8.047)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	334.493	05. Mai 2028	(309)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	EUR	125.764	18. Mai 2033	(5.142)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	262.986	18. Mai 2033	(5.937)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	196.285	18. Mai 2033	2.150
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	338.136	18. Mai 2033	1.401
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	264.042	18. Mai 2033	(5.864)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	127.349	18. Mai 2033	(721)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	EUR	75.801	05. Mai 2028	(26.908)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	SEK	68.831	05. Mai 2028	(16.875)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	171.592	19. Mai 2025	(3.573)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	346.357	18. Mai 2033	(9.623)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	341.399	18. Mai 2033	(13.949)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	848.027	18. Mai 2033	(8.537)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	337.418	18. Mai 2033	(3.255)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	335.427	18. Mai 2033	(4.727)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	275.041	18. Mai 2033	(4.999)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	64.592	18. Mai 2033	(5.096)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	201.638	18. Mai 2033	(25.437)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	159.506	18. Mai 2033	3.218
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	262.928	18. Mai 2033	(6.275)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	396.874	18. Mai 2033	(1.011)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	164.983	18. Mai 2033	(12.207)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	33.894	15. Mai 2033	(336)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	353.303	18. Mai 2033	(4.247)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	55.066	18. Mai 2033	374

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	229.790	18. Mai 2033	(4.929)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	111.532	18. Mai 2033	1.040
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	62.818	24. Mai 2033	(1.749)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	110.737	24. Mai 2033	(1.286)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	144.079	24. Mai 2033	(5.776)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	297.749	24. Mai 2033	16.513
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	275.287	18. Mai 2033	4.317
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	694.310	18. Mai 2033	8.274
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	271.429	18. Mai 2033	(18.485)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	218.306	18. Mai 2033	(8.544)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	199.106	18. Mai 2033	(111)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	164.018	18. Mai 2033	(5.853)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	269.217	18. Mai 2033	(7.085)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	150.356	18. Mai 2033	(2.947)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	101.093	18. Mai 2033	3.517
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	172.891	18. Mai 2033	1.572
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	132.263	18. Mai 2033	(959)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	166.982	18. Mai 2033	(5.322)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	101.890	15. Mai 2033	530
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	CAD	481.743	18. Mai 2033	5.993
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	399.562	19. Mai 2025	(8.003)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	166.806	18. Mai 2033	(10.433)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	307.176	18. Mai 2033	(3.269)
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	J.P. Morgan	JPY	248.018	08. Mai 2028	3.821
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Morgan Stanley	JPY	56.797	18. Mai 2033	(238)
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Morgan Stanley	USD	264.073	18. Mai 2033	(3.776)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	DKK	120.520	24. Mai 2033	(6.098)
USD						(1.335.140)

Differenzkontrakte

Differenzkontrakte (CDF, Contract of Difference) werden auf Grundlage des Börsenschlusskurses des zugrunde liegenden Wertpapiers bewertet, der in die Basiswährung des Kontrakts umgerechnet wird und von dem die den einzelnen Kontrakten zuzuschreibenden Finanzierungskosten, die separat verbucht werden, abgezogen werden. Bei Abschluss eines Differenzkontrakts müssen die Teilfonds gegebenenfalls liquide Mittel und/oder sonstige Vermögenswerte bis zu einem Betrag, der einem bestimmten prozentualen Anteil des Kontraktbetrags entspricht („Einschussumme“), zugunsten des Brokers verpfänden. Im weiteren Verlauf werden periodisch als „Schwankungsmargen“ bezeichnete Zahlungen von den Teilfonds 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 Kontrakte entfallende Dividenden werden (abzüglich Quellensteuern) als zum Ende des Berichtszeitraums zu erhaltende Dividenden behandelt. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Differenzkontrakten“ aufgeführt.

Zum 31. März 2024 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short				
CFD auf australische Aktien	UBS	360.010	5.417	12.942
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	(8.241)	(4.862)	(16.930)
CFD auf chinesische Aktien	UBS	430.886	133.199	131.064
CFD auf Aktien aus Hongkong	UBS	158.600	(54.883)	(39.700)
CFD auf indonesische Aktien	UBS	(398.100)	6.230	362
CFD auf Aktien aus Macau	UBS	57.000	(728)	(12.454)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	(14.172)	6.520	(3.079)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short (Forts.)				
CFD auf neuseeländische Aktien	UBS	105.610	(17.036)	(22.394)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	106.400	17.638	34.911
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(5.890)	(1.119)	(6.636)
CFD auf südkoreanische Aktien	UBS	(205)	4.456	3.071
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	(121.000)	11.888	(25.004)
CFD auf taiwanische Aktien	UBS	(207.000)	23.095	(16.445)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(12.610)	(13.241)	(14.027)
CFD auf US-Aktien	UBS	119.669	37.435	79.505
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	UBS	(14.021)	(48.372)	(568.684)
			USD 105.637	(463.498)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	2.158	1.686.238	45.609
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	5.437	1.115.482	91.388
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	(1.641)	(975.504)	(49.731)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	1.299	1.895.317	104.028
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	1.085	834.136	28.163
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	884	718.310	29.326
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	(4.285)	(3.313.351)	(36.048)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	2.029	2.488.374	72.215
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	1.125	1.040.522	32.454
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	3.513	1.458.202	61.512
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	1.999	978.998	16.973
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	5.777	2.266.205	64.203
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	1.381	1.603.705	(1.564)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	2.987	1.439.470	175.982
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	1.164	1.075.363	4.143
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	5.953	1.291.415	8.893
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	5.161	1.457.410	(16.314)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	3.336	1.337.081	49.230
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	3.029	4.499.540	551
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	6.560	5.341.341	164.189
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	4.764	3.435.998	315.476
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	2.432	1.705.622	76.060
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	2.451	4.225.453	92.062
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	1.501	1.601.139	66.276
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	737	2.816.113	53.417
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	5.495	3.215.450	188.166
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	(1.565)	(521.909)	(30.953)
			USD 44.716.120	1.605.706
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(26.700)	(138.670)	(138.670)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(43.606)	(522.871)	(522.871)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	(37.410)	206.542	206.542
CFD auf französische Aktien	Morgan Stanley	(33.853)	(75.601)	(75.601)
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	231.627	346.543	346.543
CFD auf indische Aktien	Morgan Stanley	(17.574)	32.863	32.863
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(11.133)	(254.055)	(254.055)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(170.500)	(49.374)	(49.374)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	386.662	32.766	32.766
CFD auf Aktien aus Singapur	Morgan Stanley	(40.573)	65.323	65.323
CFD auf taiwanische Aktien	Morgan Stanley	215.000	46.143	46.143

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)				
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1.044.931)	(957.713)	(957.713)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.809.889)	(1.965.911)	(1.965.911)
			USD (3.234.015)	(3.234.015)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	758.327	147.736	147.760
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	1.373.217	76.635	146.214
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	9.656	42.861	42.861
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	27.735	69.792	72.764
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	(1.670)	(1.533)	(1.533)
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	(47.858)	(4.530)	(4.530)
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	254.500	40.345	223.329
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	6.523.430	83.782	83.782
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	627.778	194.857	184.817
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	4.652	6.349	6.354
CFD auf chilenische Aktien	Goldman Sachs	19.088	48.467	48.467
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	6.255.595	248.542	247.302
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	4.057.327	384.138	917.263
CFD auf tschechische Aktien	Goldman Sachs	(78.431)	(104.787)	(104.787)
CFD auf tschechische Aktien	J.P. Morgan	(14.095)	42.503	30.952
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	26.733	(32)	(32)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	83.582	(79.364)	104.258
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	56.958	5.755	5.753
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	109.295	155.078	370.737
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	(6.481)	735	735
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	11.555	81.099	81.099
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	87.709	53.517	205.375
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(37.139)	(25.804)	(25.804)
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	(7.583)	55.550	55.552
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	93.310	316.941	553.883
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	2.364.591	(245.223)	(244.441)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	950.700	(283.526)	(55.182)
CFD auf ungarische Aktien	Goldman Sachs	(3.176)	2.953	2.953
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	24.110	(964)	3.128
CFD auf indonesische Aktien	J.P. Morgan	(1.338.900)	14.868	(1.742)
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	(14.621)	5.597	5.597
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	116.075	36.154	36.154
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	67.914	31.686	25.465
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	362.500	3.109	4.640
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	7.692.200	477.719	2.621.165
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	52.000	(6.312)	(6.312)
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	177.000	(15.831)	(38.465)
CFD auf mexikanische Aktien	Goldman Sachs	(55.307)	(20.979)	(20.979)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	(43.067)	(31.170)	(31.170)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	338.331	(27.320)	(54.963)
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	104.533	24.198	24.200
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	131.723	32.570	25.020
CFD auf peruanische Aktien	Goldman Sachs	546	(808)	(808)
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	(112.234)	(60.151)	(60.151)
CFD auf polnische Aktien	J.P. Morgan	(120.122)	(20.378)	(40.612)
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	77.460	(4.601)	36.070
CFD auf saudi-arabische Aktien	Goldman Sachs	(1.524)	1.059	1.059

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	43.348	(79.807)	(37.125)
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	1.211.015	211.216	211.218
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	432.600	86.539	165.665
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	64.426	142.214	142.214
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(18.109)	19.202	19.202
CFD auf südkoreanische Aktien	J.P. Morgan	(1.036)	7.233	1.762
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	96.671	235.538	235.547
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	242.742	145.582	345.366
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	12.047	42.664	42.495
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	98.039	(110.943)	(90.163)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(313.944)	(40.845)	(40.845)
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	3.414	208.178	325.438
CFD auf taiwanesischen Aktien	Goldman Sachs	(1.160.624)	(36.596)	(36.596)
CFD auf türkische Aktien	Goldman Sachs	3.239.377	172.205	172.205
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	155.448	412.570	412.922
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	695.485	358.236	833.641
CFD auf den FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(175)	(88.500)	(88.500)
CFD auf den GSCBTUK3 Index	Goldman Sachs	(23.719)	(90.488)	(90.488)
CFD auf den GSHEJVL2 Index	Goldman Sachs	23.386.915	524.337	524.337
CFD auf den GSHEJVS2 Index	Goldman Sachs	(23.129.188)	(145.280)	(145.280)
CFD auf den GSXAMFSS Clone Index	Goldman Sachs	(4.492.085)	258.155	187.193
CFD auf den HXE Chemicals Hedge Index	Goldman Sachs	(65.079)	(194.706)	(194.706)
CFD auf den HXE Chemicals Index	Goldman Sachs	62.538	(20.883)	160.971
CFD auf den HXE ER Long Index	J.P. Morgan	88.766	388.165	441.311
CFD auf den HXE ER Short Index	J.P. Morgan	(87.442)	(288.183)	(323.134)
CFD auf den HXE EU Banks Index	Goldman Sachs	67.436	370.056	503.394
CFD auf den HXE EU Value Long Index	Goldman Sachs	52.788	352.328	352.328
CFD auf den HXE EU Value Short Index	Goldman Sachs	(50.790)	(204.054)	(204.054)
CFD auf den HXE Miners Hedge Index	Goldman Sachs	(27.216)	(63.794)	(63.794)
CFD auf den HXE TSMC Hedge Index	Goldman Sachs	63.942	195.755	195.755
CFD auf den HXE US MOM Index	J.P. Morgan	3.486	18.411	(132.281)
CFD auf den HXE US Value Long Index	Goldman Sachs	82.987	564.312	564.312
CFD auf den HXE US Value Short Index	Goldman Sachs	(83.036)	(127.045)	(127.045)
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(48.268)	(1.221.976)	(1.221.976)
CFD auf den MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(276)	(16.138)	(16.138)
CFD auf den MSCI EM Latin America 10/40 Gross Total Return Index	Goldman Sachs	(1.678)	(33.747)	(33.747)
			USD 3.701.193	8.614.601
Schroder GAIA SEG US Equity				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	40.015	(296.841)	(285.732)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	57.521	(12.989)	(12.989)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	6.757	182.323	184.261
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	(124.002)	(179.830)	(185.429)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	113.453	2.805.481	2.836.989
CFD auf luxemburgische Aktien	Goldman Sachs	(13.841)	(18.818)	(19.347)
CFD auf mexikanische Aktien	Goldman Sachs	(12.827)	(370.012)	(409.121)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	463.207	926.890	1.531.071
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(704.779)	4.404.846	10.220.756
CFD auf GS Commercial Real Estate Basket	Goldman Sachs	(13.993)	(263.632)	(279.891)
CFD auf den GS CORD Index	Goldman Sachs	(15.974)	(53.860)	(48.317)
CFD auf GS CSDN Basket	Goldman Sachs	(17.434)	(44.469)	(111.905)
CFD auf GS Energy Basket	Goldman Sachs	(24.821)	(226.519)	(268.951)
CFD auf GS Flagship Basket	Goldman Sachs	(84.712)	(424.586)	(852.311)
CFD auf GS Healthcare Basket	Goldman Sachs	(24.037)	(73.530)	(99.030)
CFD auf GS Holt Defense Basket	Goldman Sachs	(29.299)	(249.344)	(234.146)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA SEG US Equity (Forts.)				
CFD auf GS Info Tech Basket	Goldman Sachs	(16.079)	(4.498)	(29.698)
CFD auf GS NRSI Basket	Goldman Sachs	(12.240)	(327.602)	(362.153)
CFD auf GS OZVT Index	Goldman Sachs	(71.002)	(590.512)	(760.940)
CFD auf GS PEVC Basket	Goldman Sachs	(30.902)	(162.309)	(192.455)
CFD auf GS PWRS Basket	Goldman Sachs	(20.890)	(139.178)	(139.232)
CFD auf den GS SHIF Index	Goldman Sachs	(15.922)	49.161	49.645
CFD auf GS SPAC Basket	Goldman Sachs	(26.836)	7.139	63.015
CFD auf GS STHK Basket	Goldman Sachs	(19.778)	18.354	48.841
CFD auf GS Utilities Basket	Goldman Sachs	(15.597)	72.458	65.916
			USD 5.028.123	10.708.847

Credit Default Index-Swapkontrakte

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

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

Am 31. März 2024 waren die folgenden Teilfonds in Credit Default Index Swapkontrakten auf Finanzindizes engagiert:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 41 20/06/2029	J.P. Morgan	EUR	37.000.000	5,00	20. Jun. 2029	3.558.875
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 41 20/06/2029	J.P. Morgan	EUR	149.000.000	1,00	20. Jun. 2029	3.576.767
Kauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	50.490.000	5,00	20. Dez. 2028	(62.004)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	50.490.000	5,00	20. Dez. 2028	3.729.016
Verkauf	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	51.000.000	5,00	20. Jun. 2029	105.847
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	229.000.000	1,00	20. Jun. 2029	5.217.370
						USD	16.125.871
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 41 20/06/2029	Citi Bank	EUR	66.000.000	1,00	20. Jun. 2029	32.981
Kauf	CDX North America Investment Grade Series 42 20/06/2029	Citi Bank	USD	20.000.000	1,00	20. Jun. 2029	(13.109)
						USD	19.872
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX Emerging Markets Series 40 20/12/2028	Morgan Stanley	USD	5.457.000	1,00	20. Dez. 2028	53.023
Kauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 40 20/12/2028	Morgan Stanley	EUR	4.957.000	1,00	20. Dez. 2028	(104.482)
Kauf	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	Morgan Stanley	USD	5.430.000	5,00	20. Jun. 2029	(17.821)
Kauf	CDX North America Investment Grade Series 42 20/06/2029	Morgan Stanley	USD	13.470.000	1,00	20. Jun. 2029	(6.976)
						USD	(76.256)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Credit Default Swapkontrakte

Ein Credit Default Swap ermöglicht die Übertragung des Ausfallrisikos. Dadurch kann der Teilfonds einen effektiven Versicherungsschutz in Bezug auf eine von ihm gehaltene Referenzanleihe (Absicherung der Anlage) oder einen Schutz in Bezug auf eine Referenzanleihe erwerben, die er nicht physisch besitzt, in der Erwartung, dass die Qualität des Kredits abnimmt. Eine Vertragspartei, der Sicherungsnehmer, leistet regelmäßige Zahlungen an den Sicherungsgeber und erhält dafür bei Eintritt eines Kreditereignisses (ein Rückgang der Kreditqualität, der zuvor von den Parteien vertraglich festgelegt wird) eine Ausgleichszahlung. Tritt das Kreditereignis nicht ein, zahlt der Sicherungsnehmer alle erforderlichen Prämien und das 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-Swapkontrakten“ aufgeführt.

Zum 31. März 2024 war der folgende Teilfonds in Credit Default Swap-Kontrakten engagiert:

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	USA	Öffentliche Hand	Barclays Bank	EUR	1.280.000	20. Jun. 2024	(20.506)
						USD	(20.506)

Cross-Currency Swapkontrakte

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

Zum 31. März 2024 war der folgende Teilfonds in Cross-Currency Swapkontrakten engagiert:

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeit	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Bank of America	USD	12.819.870	AUD	19.380.000	18. Sept. 2029	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	5.921
Morgan Stanley	USD	12.860.855	CAD	17.321.000	18. Sept. 2029	USD SOFR 1 Tag	CAD CORRA OIS 1 Tag	8.836
Morgan Stanley	USD	12.786.466	NOK	133.593.000	18. Sept. 2029	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	1.705
Morgan Stanley	USD	12.541.274	NZD	20.346.000	18. Sept. 2029	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	564
Morgan Stanley	USD	12.646.462	SEK	129.109.000	18. Sept. 2029	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	554
							USD	17.580

Inflations-Swapkontrakte

Ein Inflations-Swap ermöglicht die Übertragung von Inflationsrisiken. Eine Vertragspartei versucht, ihr Risiko (durch Absicherung) zu reduzieren, während die andere das Risiko (durch Spekulation) erhöht. Die Partei, die ihr Inflationsrisiko absichern möchte, zahlt den an einen Inflationsindex gebundenen variablen Zinssatz und erhält gleichzeitig Zahlungen zu einem festen Zinssatz. Durch den Tausch einer variablen Verzinsung gegen eine feste verringert die absichernde Partei ihr Inflationsrisiko und erhöht ihre Sicherheit hinsichtlich künftiger Zahlungsströme. Inflations-Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Inflations-Swapkontrakten“ aufgeführt.

Zum 31. März 2024 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
3.785.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,45 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(98.146)
3.785.000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,48 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	64.484
6.809.000	USD	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,49 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Sep. 2028	159.893
7.072.000	USD	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,63 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Sep. 2033	(296.334)
263.000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,60 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Sep. 2028	(6.046)
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,40 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(130.603)
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,40 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	84.035
USD					(222.717)

Zins-Swapkontrakte

Zur Absicherung gegen Zinsschwankungen kann die Gesellschaft Zins-Swapkontrakte abschließen, sofern:

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

Diese Kontrakte müssen auf die Währungen lauten, in denen die Vermögenswerte des Teilfonds 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.

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

Zum 31. März 2024 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Erhält Festzinssatz 9,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	21.489.377	BRL	04. Jan. 2027	(23.963)
Erhält Festzinssatz 9,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	58.510.623	BRL	04. Jan. 2027	(153.458)
Zahlt Festzinssatz 9,57 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	14.881.278	BRL	02. Jan. 2026	8.329
Erhält Festzinssatz 9,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	104.881.278	BRL	02. Jan. 2026	(126.199)
Erhält Festzinssatz 2,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	20.000.000	SEK	19. Jun. 2034	(21.907)
Zahlt Festzinssatz 9,80 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	90.000.000	BRL	02. Jan. 2026	14.860
Zahlt Festzinssatz 10,21 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	40.000.000	BRL	04. Jan. 2027	7.636
Zahlt Festzinssatz 3,85 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	1.000.000	USD	20. Jun. 2044	(10.363)
Zahlt Festzinssatz 9,06 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	170.000.000	MXN	17. Jun. 2026	67.098
Zahlt Festzinssatz 8,57 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	50.000.000	MXN	07. Jun. 2034	19.284
Erhält Festzinssatz 8,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	50.000.000	MXN	07. Jun. 2034	(89.865)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 9,37 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	J. P. Morgan	170.000.000	MXN	17. Jun. 2026	11.442
Zahlt Festzinssatz 8,50 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	J. P. Morgan	152.490.975	MXN	13. Jun. 2029	72.002
Erhält Festzinssatz 8,08 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	J. P. Morgan	72.490.975	MXN	13. Jun. 2029	(106.184)
Erhält Festzinssatz 2,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	20.000.000	SEK	19. Jun. 2034	(33.958)
Zahlt Festzinssatz 8,69 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	J. P. Morgan	80.000.000	MXN	13. Jun. 2029	602
Zahlt Festzinssatz 8,66 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	J. P. Morgan	25.000.000	MXN	07. Jun. 2034	878
Zahlt Festzinssatz 8,69 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	J. P. Morgan	25.000.000	MXN	07. Jun. 2034	(2.110)
Erhält Festzinssatz 4,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	3.000.000	NZD	19. Jun. 2034	6.240
Zahlt Festzinssatz 8,05 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	150.000.000	ZAR	19. Jun. 2026	10.270
Zahlt Festzinssatz 8,61 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	70.000.000	ZAR	19. Jun. 2029	9.171
Erhält Festzinssatz 4,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	6.000.000	NZD	19. Jun. 2029	2.437
Erhält Festzinssatz 2,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	45.461.307	SEK	19. Jun. 2029	(120.962)
Zahlt Festzinssatz 4,00 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	40.000.000	USD	20. Jun. 2028	(45.534)
Erhält Festzinssatz 9,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	69.680.350	ZAR	19. Jun. 2034	(154.941)
Zahlt Festzinssatz 4,00 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	12.000.000	USD	20. Jun. 2028	(13.661)
Zahlt Festzinssatz 9,82 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	69.680.350	ZAR	19. Jun. 2034	10.633
Zahlt Festzinssatz 8,14 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	624.686.131	ZAR	19. Jun. 2026	(10.775)
Zahlt Festzinssatz 4,07 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	10.000.000	USD	20. Jun. 2044	(407.641)
Zahlt Festzinssatz 2,83 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	9.461.307	SEK	19. Jun. 2029	(7.099)
Erhält Festzinssatz 7,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	24.686.131	ZAR	19. Jun. 2026	(23.545)
Erhält Festzinssatz 1,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	3.200.000	CHF	19. Jun. 2034	18.072
Erhält Festzinssatz 1,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	14.400.000	CHF	19. Jun. 2034	81.328
Erhält Festzinssatz 7,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	137.968.104	ZAR	19. Jun. 2029	(197.808)
Zahlt Festzinssatz 8,74 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	67.968.104	ZAR	19. Jun. 2029	(9.251)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,96 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J. P. Morgan	24.000.000	EUR	19. Jun. 2026	5.684
Zahlt Festzinssatz 2,96 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J. P. Morgan	32.000.000	EUR	19. Jun. 2026	7.578
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J. P. Morgan	805.854.899	JPY	19. Jun. 2044	(347.766)
Erhält Festzinssatz 1,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J. P. Morgan	325.854.899	JPY	19. Jun. 2044	(53.885)
Zahlt Festzinssatz 3,98 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	8.000.000	USD	20. Jun. 2031	(74.845)
Zahlt Festzinssatz 3,98 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	20.000.000	USD	20. Jun. 2031	(187.115)
Zahlt Festzinssatz 4,22 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	48.000.000	USD	20. Jun. 2026	119.322
Erhält Festzinssatz 1,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	7.000.000	CHF	19. Jun. 2029	6.508
Erhält Festzinssatz 1,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	14.000.000	CHF	19. Jun. 2029	13.015
Zahlt Festzinssatz 3,97 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	9.000.000	USD	20. Jun. 2049	(418.425)
Zahlt Festzinssatz 4,22 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	56.000.000	USD	20. Jun. 2026	139.210
Zahlt Festzinssatz 3,23 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	430.000.000	SEK	19. Jun. 2026	(144.284)
				USD	(2.153.945)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Erhält Festzinssatz 11,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6.608.245	BRL	02. Jan. 2026	14.977
Erhält Festzinssatz 4,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	37.949.000	CZK	14. Dez. 2033	16.744
Erhält Festzinssatz 10,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	3.657.155	BRL	01. Jul. 2026	(6.122)
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	67.600.000	MXN	19. Jul. 2028	70.465
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.970.000	USD	20. Dez. 2033	12.452
Erhält Festzinssatz 11,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	290.430.000	MXN	01. Mai 2024	522
Zahlt Festzinssatz 3,82 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	22.167.000	PLN	19. Mrz. 2026	51.064
Erhält Festzinssatz 9,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.279.830.000	COP	20. Dez. 2033	32.918
Erhält Festzinssatz 6,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.864.615.000	HUF	19. Mrz. 2026	54.005
Erhält Festzinssatz 10,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.655.493	BRL	02. Jan. 2029	(7.894)
Erhält Festzinssatz 10,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.624.691	BRL	02. Jan. 2029	(17.614)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 8,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16.155.000	MXN	21. Nov. 2033	1.714
Zahlt Festzinssatz 8,79 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92.095.000	MXN	27. Nov. 2028	20.346
Erhält Festzinssatz 5,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.872.496.000	HUF	19. Jun. 2026	(47.654)
Erhält Festzinssatz 10,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	5.214.556	BRL	02. Jan. 2029	(11.549)
Erhält Festzinssatz 9,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	25.679.110	BRL	02. Jan. 2026	(18.474)
Erhält Festzinssatz 3,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	5.527.000	MYR	20. Jun. 2029	(1.828)
Zahlt Festzinssatz 7,17 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.713.496.000	COP	17. Jun. 2029	1.026
Zahlt Festzinssatz 4,84 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	952.869.000	CLP	21. Jun. 2034	26.780
Zahlt Festzinssatz 7,65 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8.501.694.000	COP	20. Jun. 2026	725
Zahlt Festzinssatz 7,64 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8.388.514.000	COP	20. Jun. 2026	1.115
Zahlt Festzinssatz 7,49 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	55.271.000	ZAR	18. Jun. 2026	11.270
Zahlt Festzinssatz 7,50 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	78.719.000	ZAR	18. Jun. 2026	16.622
Zahlt Festzinssatz 7,74 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	20.684.015.000	COP	20. Jun. 2026	(7.303)
Zahlt Festzinssatz 7,76 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8.380.882.000	COP	20. Jun. 2026	(3.482)
Erhält Festzinssatz 10,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	3.482.262	BRL	02. Jan. 2029	(16.733)
Erhält Festzinssatz 10,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	3.479.662	BRL	02. Jan. 2029	(16.296)
Erhält Festzinssatz 10,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.128.609	BRL	02. Jan. 2029	(26.698)
Zahlt Festzinssatz 3,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	6.876.000	MYR	20. Jun. 2026	2.826
Zahlt Festzinssatz 3,86 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	9.667.000	MYR	18. Mrz. 2029	(7.159)
Erhält Festzinssatz 4,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.345.490.000	CLP	17. Jun. 2029	(14.810)
Erhält Festzinssatz 4,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.130.000	USD	21. Jan. 2025	(3.081)
Zahlt Festzinssatz 3,53 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	885.000	USD	25. Jan. 2030	6.975
Erhält Festzinssatz 10,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	1.013.397	BRL	02. Jan. 2029	(6.281)
Erhält Festzinssatz 10,08 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	929.192	BRL	02. Jan. 2029	(5.090)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,36 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.390.000	ZAR	19. Jun. 2029	10.509
Zahlt Festzinssatz 3,36 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.671.339.000	KRW	20. Jun. 2034	(13.850)
Erhält Festzinssatz 4,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.425.000	USD	24. Feb. 2025	(5.938)
Erhält Festzinssatz 7,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.753.435.000	COP	20. Jun. 2034	(6.423)
Zahlt Festzinssatz 7,50 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	19.622.717.000	COP	20. Jun. 2026	15.695
Erhält Festzinssatz 7,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	11.748.375.000	COP	20. Jun. 2026	(2.631)
Zahlt Festzinssatz 2,98 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	662.000	SGD	19. Jun. 2034	(1.610)
Zahlt Festzinssatz 3,00 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	972.000	SGD	19. Jun. 2034	(3.765)
Erhält Festzinssatz 3,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.665.000	SGD	19. Jun. 2026	(817)
Erhält Festzinssatz 7,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	554.763.000	COP	20. Jun. 2034	(959)
Erhält Festzinssatz 8,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.719.488.000	COP	20. Jun. 2034	840
Zahlt Festzinssatz 8,05 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9.028.000	ZAR	19. Jun. 2025	725
Zahlt Festzinssatz 3,64 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	4.915.000	MYR	20. Jun. 2026	(1.595)
Zahlt Festzinssatz 5,54 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.057.445.000	HUF	19. Jun. 2026	41.565
Erhält Festzinssatz 9,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	14.940.192	BRL	02. Jan. 2026	(12.855)
Zahlt Festzinssatz 7,03 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10.787.900.000	COP	20. Jun. 2029	25.410
Erhält Festzinssatz 5,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	102.905.000	PLN	19. Jun. 2025	(8.827)
Erhält Festzinssatz 7,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.794.425.000	COP	20. Jun. 2034	(17.375)
Erhält Festzinssatz 7,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	23.930.250.000	COP	20. Jun. 2026	(31.391)
Erhält Festzinssatz 7,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.063.385.000	COP	20. Jun. 2034	(2.350)
Zahlt Festzinssatz 3,36 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	58.931.000	CZK	18. Sep. 2034	55.133
Erhält Festzinssatz 3,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	12.911.000	ILS	18. Sep. 2029	(22.542)
Erhält Festzinssatz 4,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.516.000	PLN	18. Sep. 2029	(988)
Zahlt Festzinssatz 2,22 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.220.000	EUR	17. Sep. 2026	(4.714)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,31 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 6 Months	Morgan Stanley	12.148.000	CAD	18. Sep. 2029	(27.105)
Erhält Festzinssatz 2,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	477.000	SGD	19. Jun. 2029	(1.437)
Zahlt Festzinssatz 3,24 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.994.022.000	KRW	20. Jun. 2034	345
Erhält Festzinssatz 7,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.401.850.000	COP	19. Sep. 2034	(8.265)
Erhält Festzinssatz 9,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	49.365.000	MXN	16. Sep. 2026	(2.188)
Zahlt Festzinssatz 7,32 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10.207.100.000	COP	20. Jun. 2029	(8.315)
Erhält Festzinssatz 7,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.091.455.000	COP	20. Jun. 2034	6.065
Erhält Festzinssatz 7,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	11.230.285.000	COP	20. Jun. 2026	4.019
Zahlt Festzinssatz 3,29 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5.537.000	SGD	19. Jun. 2025	(869)
Erhält Festzinssatz 7,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.736.876.000	COP	20. Jun. 2034	9.039
Erhält Festzinssatz 8,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5.456.049.000	COP	20. Jun. 2034	7.089
Zahlt Festzinssatz 9,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	15.290.000	MXN	24. Feb. 2028	(10.191)
Erhält Festzinssatz 8,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	9.385.000	MXN	30. Mrz. 2033	(15.152)
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	39.665.000	MXN	11. Apr. 2028	17.299
Erhält Festzinssatz 2,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	30.828.000	SEK	17. Dez. 2028	(12.536)
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36.765.000	MXN	14. Jun. 2028	38.239
Erhält Festzinssatz 8,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.005.000	MXN	13. Jul. 2033	(40.056)
Erhält Festzinssatz 11,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	404.630.000	MXN	26. Apr. 2024	837
Zahlt Festzinssatz 3,94 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	69.016.000	NOK	18. Mrz. 2029	(76.063)
Erhält Festzinssatz 9,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	2.680.000	MXN	26. Aug. 2033	2.848
Erhält Festzinssatz 3,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.833.000	USD	19. Mrz. 2026	5.660
Zahlt Festzinssatz 1,31 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	37.478.000	JPY	21. Mrz. 2034	(1.838)
Erhält Festzinssatz 3,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	608.979.000	KRW	18. Mrz. 2029	5.752
Zahlt Festzinssatz 3,09 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.973.000	EUR	21. Mrz. 2034	(17.092)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	6.695.000	ILS	21. Mrz. 2034	(24.330)
Erhält Festzinssatz 5,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.068.000	PLN	21. Mrz. 2034	5.134
Erhält Festzinssatz 9,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.915.000	MXN	31. Aug. 2033	42.887
Zahlt Festzinssatz 9,38 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	52.500.000	MXN	06. Sep. 2028	(54.981)
Erhält Festzinssatz 9,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.725.000	MXN	01. Sep. 2033	21.785
Erhält Festzinssatz 4,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.471.000	NZD	20. Dez. 2033	20.038
Erhält Festzinssatz 9,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42.185.000	MXN	16. Sep. 2033	140.314
Erhält Festzinssatz 5,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.706.000	PLN	20. Dez. 2033	40.384
Zahlt Festzinssatz 4,01 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.874.000	ILS	18. Mrz. 2029	(1.692)
Erhält Festzinssatz 9,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	17.665.000	MXN	03. Okt. 2033	47.165
Zahlt Festzinssatz 11,76 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	7.843.000	ZAR	21. Mrz. 2034	(335)
Erhält Festzinssatz 3,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.431.000	SGD	18. Mrz. 2029	19.318
Erhält Festzinssatz 9,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8.700.000	MXN	24. Okt. 2033	19.443
Erhält Festzinssatz 9,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14.340.000	MXN	10. Nov. 2026	2.858
Zahlt Festzinssatz 9,97 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	7.245.000	MXN	12. Nov. 2025	623
Erhält Festzinssatz 9,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	43.390.000	MXN	11. Nov. 2026	(134)
Erhält Festzinssatz 11,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	124.850.000	MXN	13. Nov. 2024	1.029
Zahlt Festzinssatz 9,98 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.071.500	MXN	13. Nov. 2025	1.496
Erhält Festzinssatz 9,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.832.000	MXN	12. Nov. 2026	(82)
Erhält Festzinssatz 8,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	10.080.000	MXN	08. Nov. 2030	839
Zahlt Festzinssatz 9,83 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	117.055.000	MXN	27. Nov. 2025	22.270
Erhält Festzinssatz 10,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	95.505.000	MXN	28. Nov. 2024	(3.071)
Erhält Festzinssatz 9,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	40.220.000	MXN	26. Nov. 2026	(8.940)
Erhält Festzinssatz 3,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	40.444.000	CZK	19. Jun. 2029	8.788

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,81 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18.057.000	CZK	19. Jun. 2034	(9.788)
Erhält Festzinssatz 3,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.209.000	ILS	19. Jun. 2029	(12.886)
Zahlt Festzinssatz 3,53 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.714.000	ILS	17. Jun. 2029	10.498
Zahlt Festzinssatz 3,06 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	32.370.000	ILS	19. Mrz. 2026	46.248
Erhält Festzinssatz 3,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6.062.906.000	KRW	20. Jun. 2026	845
Erhält Festzinssatz 3,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	983.306.000	KRW	20. Jun. 2029	2.598
Zahlt Festzinssatz 3,34 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	5.198.931.000	KRW	20. Jun. 2034	(38.195)
Zahlt Festzinssatz 6,40 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	382.340.000	INR	20. Jun. 2026	(255)
Zahlt Festzinssatz 6,41 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	475.699.000	INR	17. Jun. 2029	(15.597)
Erhält Festzinssatz 6,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	407.503.000	INR	20. Jun. 2029	16.928
Erhält Festzinssatz 2,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Day	Morgan Stanley	9.947.000	CNY	17. Jun. 2029	(3.367)
Erhält Festzinssatz 4,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7.956.185.000	CLP	19. Mrz. 2026	(43.560)
Erhält Festzinssatz 4,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.025.289.000	CLP	17. Jun. 2029	(9.929)
Erhält Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.984.000	USD	17. Jun. 2029	(33.727)
Erhält Festzinssatz 4,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	262.358.000	CLP	21. Jun. 2029	(5.497)
Erhält Festzinssatz 2,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1.895.000	SGD	19. Jun. 2026	(10.069)
Erhält Festzinssatz 8,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	70.738.000	MXN	07. Jun. 2034	(53.892)
Zahlt Festzinssatz 9,70 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	217.508.000	MXN	18. Jun. 2025	67.271
Erhält Festzinssatz 9,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	400.391.000	MXN	17. Jun. 2026	(138.523)
Erhält Festzinssatz 2,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	31.539.760	SEK	19. Jun. 2029	(8.014)
Zahlt Festzinssatz 2,59 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.936.000	EUR	19. Jun. 2034	(42.459)
Erhält Festzinssatz 2,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.555.000	EUR	19. Jun. 2029	(24.008)
Erhält Festzinssatz 4,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	4.271.000	GBP	19. Jun. 2026	1.527
Zahlt Festzinssatz 2,72 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	400.000	SGD	19. Jun. 2034	6.388

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,41 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.255.000	PLN	19. Jun. 2034	105.085
Erhält Festzinssatz 4,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.630.000	PLN	19. Jun. 2026	(7.662)
Erhält Festzinssatz 4,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.571.000	PLN	19. Jun. 2029	(44.821)
Erhält Festzinssatz 9,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	82.784.000	ZAR	19. Jun. 2034	(134.840)
Erhält Festzinssatz 9,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	95.342.000	ZAR	19. Jun. 2034	(166.188)
Zahlt Festzinssatz 7,60 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9.875.000	ZAR	19. Jun. 2026	4.864
Zahlt Festzinssatz 8,22 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	95.790.000	ZAR	19. Jun. 2029	91.098
Erhält Festzinssatz 9,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	106.476.000	ZAR	19. Jun. 2034	(199.370)
Zahlt Festzinssatz 4,84 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.580.000	NZD	19. Jun. 2026	(9.575)
Erhält Festzinssatz 4,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6.258.000	NZD	17. Jun. 2029	44.385
Erhält Festzinssatz 4,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.455.000	USD	20. Dez. 2024	(22.989)
Erhält Festzinssatz 8,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	7.605.000	MXN	08. Dez. 2033	(7.280)
Zahlt Festzinssatz 4,06 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	27.143.000	PLN	18. Jun. 2026	35.109
Zahlt Festzinssatz 4,09 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	12.087.000	PLN	18. Jun. 2026	14.762
Zahlt Festzinssatz 3,20 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.285.152.000	KRW	20. Jun. 2034	2.322
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	408.820.000	KRW	20. Jun. 2034	1.752
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	12.586.000	MXN	13. Jun. 2029	11.229
Erhält Festzinssatz 4,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.870.000	USD	10. Jan. 2025	(15.030)
Erhält Festzinssatz 3,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.286.189.000	KRW	20. Jun. 2029	(8.638)
Zahlt Festzinssatz 4,37 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	492.000	PLN	19. Jun. 2034	5.367
Erhält Festzinssatz 4,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.793.000	PLN	19. Jun. 2029	(40.769)
Zahlt Festzinssatz 3,56 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.771.000	ILS	17. Jun. 2029	15.310
Zahlt Festzinssatz 2,94 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	23.105.000	SEK	19. Jun. 2025	(2.172)
Erhält Festzinssatz 8,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6.712.500	MXN	04. Jan. 2034	(7.549)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,53 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.670.000	PLN	19. Jun. 2034	21.304
Zahlt Festzinssatz 3,73 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.348.000	ILS	17. Jun. 2029	7.872
Zahlt Festzinssatz 6,17 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	54.057.000	INR	20. Jun. 2026	2.666
Zahlt Festzinssatz 8,14 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	116.133.000	MXN	17. Jun. 2026	23.279
Zahlt Festzinssatz 4,56 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.110.036	PLN	19. Jun. 2034	8.175
Zahlt Festzinssatz 4,59 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.840.522	PLN	19. Jun. 2034	12.338
Erhält Festzinssatz 4,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.695.000	USD	21. Jan. 2025	(4.874)
Erhält Festzinssatz 9,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.940.000	MXN	15. Jan. 2027	(18.177)
Zahlt Festzinssatz 3,28 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1.677.000	GBP	17. Jun. 2029	4.011
Erhält Festzinssatz 4,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.820.000	USD	29. Jan. 2025	(8.320)
Zahlt Festzinssatz 4,09 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6.124.000	AUD	19. Jun. 2025	(1.124)
Erhält Festzinssatz 2,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	803.000	SGD	20. Jun. 2034	(2.600)
Erhält Festzinssatz 2,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	580.000	SGD	20. Jun. 2034	(1.037)
Erhält Festzinssatz 5,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.465.000	PLN	20. Jun. 2034	(817)
Erhält Festzinssatz 4,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	248.283.000	CLP	21. Jun. 2029	(6.916)
Zahlt Festzinssatz 5,05 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	21.279.000	PLN	19. Jun. 2025	30.962
Zahlt Festzinssatz 5,07 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	31.918.000	PLN	19. Jun. 2025	44.731
Erhält Festzinssatz 3,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	34.152.000	CZK	17. Jun. 2029	(9.076)
Erhält Festzinssatz 3,46 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	8.979.000	ILS	19. Jun. 2025	(10.588)
Erhält Festzinssatz 5,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	231.805.000	CLP	21. Jun. 2034	127
Erhält Festzinssatz 8,57 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	4.495.000	MXN	07. Jun. 2034	(1.814)
Erhält Festzinssatz 8,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8.992.000	MXN	07. Jun. 2034	(10.239)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.309.500	MXN	13. Jun. 2029	16.322
Zahlt Festzinssatz 8,55 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	9.154.500	MXN	13. Jun. 2029	3.240

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,52 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	7.324.000	MXN	13. Jun. 2029	3.030
Erhält Festzinssatz 8,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	3.597.000	MXN	07. Jun. 2034	(1.559)
Erhält Festzinssatz 3,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18.873.000	CZK	19. Jun. 2029	(11.040)
Zahlt Festzinssatz 3,24 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.294.034.000	KRW	20. Jun. 2034	(1.153)
Zahlt Festzinssatz 2,47 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.170.000	EUR	17. Jun. 2029	(5.126)
Zahlt Festzinssatz 0,34 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	9.254.435.000	JPY	19. Jun. 2026	(10.407)
Zahlt Festzinssatz 3,94 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	17.459.000	GBP	20. Mrz. 2029	(181.344)
Erhält Festzinssatz 9,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	23.816.000	ZAR	19. Jun. 2034	(28.988)
Zahlt Festzinssatz 7,82 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	79.705.000	ZAR	19. Jun. 2026	23.068
Zahlt Festzinssatz 4,40 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.065.554.000	CLP	21. Jun. 2026	23.655
Erhält Festzinssatz 3,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	55.592.000	CZK	19. Jun. 2026	(22.043)
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	14.131.080	ZAR	19. Jun. 2029	11.547
Zahlt Festzinssatz 8,34 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.754.000	ZAR	19. Jun. 2029	11.585
Zahlt Festzinssatz 8,31 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.731.000	ZAR	19. Jun. 2029	12.550
Zahlt Festzinssatz 3,35 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.170.819.000	KRW	20. Jun. 2034	(16.505)
Erhält Festzinssatz 3,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.035.368.000	KRW	20. Jun. 2029	6.863
Erhält Festzinssatz 3,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	5.339.152.000	KRW	20. Jun. 2029	20.623
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.307.920	ZAR	19. Jun. 2029	9.759
Zahlt Festzinssatz 3,54 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	5.020.000	MYR	20. Jun. 2026	369
Zahlt Festzinssatz 7,83 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	38.178.000	ZAR	19. Jun. 2026	10.580
Zahlt Festzinssatz 4,96 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.800.000	PLN	19. Jun. 2026	30.308
Erhält Festzinssatz 5,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	44.080.000	PLN	19. Jun. 2025	(30.955)
Erhält Festzinssatz 9,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	49.506.000	ZAR	19. Jun. 2034	(34.471)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,51 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	80.864.000	ZAR	19. Jun. 2029	27.113
Zahlt Festzinssatz 8,02 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	65.137.000	ZAR	19. Jun. 2026	6.171
Zahlt Festzinssatz 3,32 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	556.162.000	KRW	20. Jun. 2034	(3.252)
Erhält Festzinssatz 8,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	10.498.000	MXN	14. Jun. 2034	(419)
Erhält Festzinssatz 5,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.059.055.000	CLP	21. Jun. 2034	19.162
Erhält Festzinssatz 5,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.105.027.000	HUF	19. Jun. 2026	(48.103)
Erhält Festzinssatz 5,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	469.412.000	HUF	19. Jun. 2026	(20.434)
Zahlt Festzinssatz 7,95 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	82.754.000	ZAR	19. Jun. 2026	13.392
Zahlt Festzinssatz 3,62 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	2.629.000	MYR	20. Jun. 2026	(650)
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	32.950.000	MXN	27. Feb. 2029	7.576
Erhält Festzinssatz 2,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	71.251.000	SEK	18. Jun. 2026	1.348
Zahlt Festzinssatz 8,05 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9.105.000	ZAR	19. Jun. 2025	708
Zahlt Festzinssatz 8,07 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.849.000	ZAR	19. Jun. 2025	764
Erhält Festzinssatz 9,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34.210.000	MXN	03. Mrz. 2027	(7.287)
Zahlt Festzinssatz 4,66 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.156.350.000	CLP	21. Jun. 2029	31.289
Erhält Festzinssatz 2,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.960.000	EUR	19. Jun. 2026	5.153
Zahlt Festzinssatz 2,63 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.335.000	EUR	19. Jun. 2029	(25.269)
Erhält Festzinssatz 2,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.675.000	EUR	19. Jun. 2031	14.010
Zahlt Festzinssatz 5,57 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	615.180.000	HUF	19. Jun. 2029	43.756
Erhält Festzinssatz 5,90 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	622.635.000	HUF	19. Jun. 2034	(66.818)
Erhält Festzinssatz 6,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	264.835.000	INR	20. Jun. 2026	(5.892)
Zahlt Festzinssatz 6,28 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	220.050.000	INR	20. Jun. 2029	8.752
Zahlt Festzinssatz 5,17 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	36.065.000	PLN	19. Jun. 2026	8.960
Zahlt Festzinssatz 4,72 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	32.985.000	PLN	19. Jun. 2029	50.165

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.815.000	PLN	19. Jun. 2034	(27.620)
Erhält Festzinssatz 4,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.235.000	USD	20. Jun. 2026	(13.155)
Zahlt Festzinssatz 3,81 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.370.000	USD	20. Jun. 2029	13.497
Zahlt Festzinssatz 3,72 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	960.000	USD	20. Jun. 2034	7.431
Erhält Festzinssatz 7,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	145.540.000	ZAR	19. Jun. 2026	(27.274)
Zahlt Festzinssatz 8,40 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	112.330.000	ZAR	19. Jun. 2029	65.924
Erhält Festzinssatz 8,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.915.000	ZAR	19. Jun. 2031	(12.471)
Erhält Festzinssatz 11,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.245.000	ZAR	20. Jun. 2034	(20.242)
Erhält Festzinssatz 3,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.840.000	MYR	20. Jun. 2029	(2.083)
Zahlt Festzinssatz 1,95 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Day	Morgan Stanley	17.988.000	CNY	20. Jun. 2026	11.863
Zahlt Festzinssatz 9,74 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	146.150.000	MXN	11. Mrz. 2026	12.475
Erhält Festzinssatz 10,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	145.105.000	MXN	12. Mrz. 2025	(897)
Erhält Festzinssatz 9,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	50.135.000	MXN	10. Mrz. 2027	(7.368)
Erhält Festzinssatz 6,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	516.886.000	HUF	20. Jun. 2034	(13.854)
Zahlt Festzinssatz 4,78 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.000.763.000	CLP	21. Jun. 2026	8.478
Erhält Festzinssatz 3,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	62.957.000	CZK	18. Sep. 2026	(24.354)
Erhält Festzinssatz 3,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.642.000	CZK	18. Sep. 2029	(8.596)
Zahlt Festzinssatz 5,91 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	133.170.000	HUF	18. Sep. 2034	12.805
Erhält Festzinssatz 5,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	245.373.000	HUF	18. Sep. 2026	(7.672)
Zahlt Festzinssatz 5,43 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	25.873.000	PLN	18. Sep. 2025	(1.141)
Erhält Festzinssatz 5,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	78.656.000	PLN	18. Sep. 2026	13.462
Erhält Festzinssatz 5,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	443.064.000	HUF	18. Sep. 2029	(29.855)
Zahlt Festzinssatz 4,96 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.584.000	PLN	18. Sep. 2034	(1.050)
Erhält Festzinssatz 4,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	9.147.000	AUD	18. Sep. 2034	36.563

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,78 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	12.608.000	AUD	18. Sep. 2026	(6.229)
Zahlt Festzinssatz 3,84 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.646.000	AUD	16. Sep. 2029	(10.693)
Zahlt Festzinssatz 4,59 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	7.560.000	AUD	19. Sep. 2034	(15.183)
Zahlt Festzinssatz 3,56 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2.300.000	GBP	18. Sep. 2034	(6.114)
Erhält Festzinssatz 3,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	812.000	GBP	17. Sep. 2026	779
Erhält Festzinssatz 3,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2.642.000	GBP	19. Sep. 2034	2.272
Erhält Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.406.000	NOK	18. Sep. 2034	(7.018)
Erhält Festzinssatz 3,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	10.592.000	NOK	17. Sep. 2026	552
Zahlt Festzinssatz 3,20 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.065.475.000	KRW	19. Sep. 2034	125
Erhält Festzinssatz 3,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	50.628.000	NOK	18. Sep. 2029	(20.188)
Zahlt Festzinssatz 3,38 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18.011.000	NOK	19. Sep. 2034	5.213
Erhält Festzinssatz 3,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6.980.023.000	KRW	17. Sep. 2026	(1.176)
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	5.655.472.000	KRW	19. Sep. 2026	(2.499)
Zahlt Festzinssatz 3,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	1.065.000	MYR	17. Sep. 2029	201
Erhält Festzinssatz 3,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	14.308.000	MYR	18. Sep. 2029	(5.340)
Zahlt Festzinssatz 4,19 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	15.127.000	NZD	18. Sep. 2029	(27.413)
Zahlt Festzinssatz 7,85 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	211.371.000	ZAR	18. Sep. 2026	47.581
Zahlt Festzinssatz 2,44 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	54.877.000	SEK	18. Sep. 2034	27.453
Erhält Festzinssatz 3,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	11.464.000	ILS	18. Sep. 2026	(9.437)
Erhält Festzinssatz 0,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	31.906.000	JPY	18. Sep. 2034	1.055
Zahlt Festzinssatz 2,92 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	3.846.000	SGD	18. Sep. 2034	9.261
Erhält Festzinssatz 2,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	15.361.000	SGD	18. Sep. 2026	(9.140)
Erhält Festzinssatz 2,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1.231.000	SGD	16. Sep. 2029	(1.580)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,32 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	61.255.000	CZK	19. Jun. 2026	20.294
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	38.260.000	CLP	16. Sep. 2029	(93)
Erhält Festzinssatz 4,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6.305.227.000	CLP	23. Sep. 2029	(46.412)
Erhält Festzinssatz 5,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	253.841.000	CLP	20. Sep. 2034	557
Zahlt Festzinssatz 5,07 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.828.674.000	CLP	23. Sep. 2034	24.698
Erhält Festzinssatz 6,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	115.954.000	INR	18. Sep. 2029	(3.151)
Zahlt Festzinssatz 9,47 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10.660.413.000	COP	20. Jun. 2025	(18.131)
Zahlt Festzinssatz 10,22 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	62.932.000	MXN	18. Jun. 2025	716
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	207.119.000	MXN	12. Sep. 2029	44.680
Erhält Festzinssatz 8,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	59.751.000	MXN	06. Sep. 2034	(19.307)
Zahlt Festzinssatz 4,13 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	6.014.000	CAD	18. Sep. 2025	(1.892)
Zahlt Festzinssatz 3,00 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	2.678.000	CAD	16. Sep. 2029	(3.956)
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	2.054.000	CAD	19. Sep. 2034	(3.159)
Erhält Festzinssatz 3,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	6.434.000	CAD	18. Sep. 2034	29.010
Zahlt Festzinssatz 2,75 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.020.000	EUR	18. Sep. 2026	(1.323)
Erhält Festzinssatz 5,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.222.000	PLN	20. Jun. 2034	184
Zahlt Festzinssatz 4,19 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	11.976.000	NZD	17. Sep. 2026	(8.879)
Zahlt Festzinssatz 8,36 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	281.032.000	MXN	16. Sep. 2026	(5.173)
Zahlt Festzinssatz 3,81 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.610.000	USD	18. Sep. 2034	(19.121)
Erhält Festzinssatz 4,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.191.000	USD	18. Sep. 2025	518
Zahlt Festzinssatz 4,22 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	22.454.000	USD	18. Sep. 2026	(30.694)
Erhält Festzinssatz 3,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.554.000	USD	18. Sep. 2029	26.981
Zahlt Festzinssatz 8,01 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.677.000	ZAR	19. Jun. 2026	2.279

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5.545.000	USD	20. Mrz. 2025	92
Zahlt Festzinssatz 6,08 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.032.510.000	HUF	19. Jun. 2026	20.017
Zahlt Festzinssatz 8,64 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	47.630.000	ZAR	19. Jun. 2029	3.297
Erhält Festzinssatz 8,08 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	53.240.000	ZAR	19. Jun. 2026	(2.075)
Erhält Festzinssatz 9,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	2.655.000	ZAR	19. Jun. 2034	(778)
Zahlt Festzinssatz 6,62 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.834.690.000	HUF	19. Jun. 2025	(789)
Erhält Festzinssatz 6,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	579.465.000	HUF	20. Jun. 2034	(3.481)
Erhält Festzinssatz 3,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	51.770.000	CZK	19. Jun. 2029	(18.127)
Zahlt Festzinssatz 3,52 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	124.370.000	CZK	19. Jun. 2026	20.418
Erhält Festzinssatz 6,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	247.035.000	HUF	19. Jun. 2034	(10.078)
Erhält Festzinssatz 8,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	52.775.000	ZAR	19. Jun. 2026	(2.805)
Erhält Festzinssatz 4,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.312.460.000	CLP	21. Jun. 2027	(4.443)
Erhält Festzinssatz 4,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.312.465.000	CLP	21. Jun. 2027	(3.431)
Erhält Festzinssatz 3,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	15.126.000	ILS	19. Jun. 2026	(1.104)
Zahlt Festzinssatz 3,87 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	20.748.000	ILS	19. Jun. 2025	2.360
Zahlt Festzinssatz 3,89 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	20.816.000	ILS	19. Jun. 2025	1.291
Erhält Festzinssatz 3,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	15.169.000	ILS	19. Jun. 2026	(1.300)
Zahlt Festzinssatz 6,44 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	97.573.000	INR	20. Jun. 2026	(1.055)
Zahlt Festzinssatz 3,26 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.467.277.000	KRW	20. Jun. 2034	(1.627)
Zahlt Festzinssatz 4,92 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.621.975.000	CLP	21. Jun. 2031	14.306
Zahlt Festzinssatz 4,94 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	310.095.000	CLP	21. Jun. 2031	1.393
Zahlt Festzinssatz 3,60 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	62.535.000	CZK	19. Jun. 2026	6.290
Zahlt Festzinssatz 9,80 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	145.240.000	MXN	25. Mrz. 2026	(1.605)
Erhält Festzinssatz 10,65 %					

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	144.570.000	MXN	26. Mrz. 2025	(577)
Erhält Festzinssatz 9,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	49.795.000	MXN	24. Mrz. 2027	1.234
Zahlt Festzinssatz 4,96 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.919.325.000	CLP	21. Jun. 2026	1.904
Erhält Festzinssatz 5,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.455.000	PLN	19. Jun. 2034	2.334
Erhält Festzinssatz 6,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	128.778.120	HUF	19. Jun. 2034	2.545
Erhält Festzinssatz 6,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	244.871.880	HUF	19. Jun. 2034	4.840
Erhält Festzinssatz 10,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI	Morgan Stanley	13.201.444	BRL	02. Jan. 2026	5.814
Zahlt Festzinssatz 9,83 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	101.425.000	MXN	28. Mrz. 2024	772
Erhält Festzinssatz 10,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	100.760.000	MXN	25. Feb. 2025	3.992
Erhält Festzinssatz 9,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34.845.000	MXN	23. Feb. 2027	(1.030)
Zahlt Festzinssatz 3,43 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	7.943.000	CAD	17. Sep. 2026	(2.898)
				USD	(358.791)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 31. März 2024 bestand das folgende Risiko bei in Bezug auf Derivatkontrakte einzufordernden Sicherheiten je Kontrahent:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Asian Equity Long Short				
	UBS	Barmittel	HKD	33.425
	UBS	Barmittel	NZD	2
	UBS	Barmittel	USD	4.533
			USD	8.805
Schroder GAIA BlueTrend				
	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	60.068
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	6.556.818
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	31.224.607
			USD	38.365.035
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Barmittel	EUR	80.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	6.959.927
			EUR	7.039.928
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	54.615
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	1.246.517
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	5.163.588
	Goldman Sachs	Barmittel	ZAR	427.995
	J.P. Morgan	Barmittel	AUD	686.901

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	13.892
	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	41
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	9.124.552
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	170.500
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2.762.503
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	781.486.097
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	21.252.410
			USD	44.103.311
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	1.330.000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	100.000
			USD	1.430.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	Citi Bank	Barmittel	EUR	2.957.194
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	586.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	910.607
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	17.576.581
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	121.459.431
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	310.597
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	3.374.182
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	1.493.747
	Société Générale	Barmittel	CAD	54
	Société Générale	Barmittel	CHF	15
	Société Générale	Barmittel	CZK	2
	Société Générale	Barmittel	EUR	47
	Société Générale	Barmittel	JPY	4.844
	Société Générale	Barmittel	MXN	1
	Société Générale	Barmittel	PLN	24.867
	Société Générale	Barmittel	SEK	2.125.095
	Société Générale	Barmittel	TWD	2.130.409
	Société Générale	Barmittel	USD	16.474.345
	Société Générale	Barmittel	ZAR	1
			USD	44.438.225
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	130.000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	130.000
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	780.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	373.336
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	81.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	7.916
	Morgan Stanley	Barmittel	CZK	530
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	7
	Morgan Stanley	Barmittel	HKD	66.251
	Morgan Stanley	Barmittel	ILS	11
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	230.028
	Morgan Stanley	Barmittel	MXN	729.996
	Morgan Stanley	Barmittel	NZD	24
	Morgan Stanley	Barmittel	PLN	548
	Morgan Stanley	Barmittel	SEK	625
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	11
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	410.000
	UBS	Barmittel	USD	790.000
			USD	2.754.327

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für den Berichtszeitraum fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	7.675
Schroder GAIA BlueTrend	USD	77.320
Schroder GAIA Cat Bond	USD	20.010
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	129.083
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	97.362
Schroder GAIA Helix	USD	393.194
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	2.865
Schroder GAIA SEG US Equity	USD	45.065
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	97.506
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	66.388
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	396.032

Dividenden

Während des Berichtszeitraums haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
13. Okt. 2023	20. Okt. 2023	27. Okt. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	1.050,67	USD	4,040275
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1.550,34	SGD	5,345083
10. Nov. 2023	17. Nov. 2023	24. Nov. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.229,41	USD	8,572672
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.599,90	SGD	11,250747
08. Dez. 2023	15. Dez. 2023	22. Dez. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.095,20	USD	8,056288
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.868,74	SGD	10,579876
28. Dez. 2023	29. Dez. 2023	04. Jan. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	303.962,29	USD	25,794514
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	137,99	CHF	1,289272
28. Dez. 2023	29. Dez. 2023	08. Jan. 2024	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch.	26,23	USD	1,614408
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch.	23,82	USD	1,479462
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	151,87	EUR	1,428726
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert	148,10	GBP	1,383172
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch.	26,09	USD	1,609750
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	150,73	CHF	1,398655
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	165,93	EUR	1,551357
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert	161,97	GBP	1,501928
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	154,79	CHF	1,433196
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	170,07	EUR	1,58725
12. Jan. 2024	19. Jan. 2024	26. Jan. 2024	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	28.026,76	GBP	1,536468
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	12,09	USD	8,060000
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.638,74	USD	9,516507

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	4.576,63	SGD	12,509577
09. Feb. 2024	16. Feb. 2024	23. Feb. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	1.314,81	USD	6,569136
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.148,09	USD	7,746725
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.901,15	SGD	10,222345
08. Mrz. 2024	15. Mrz. 2024	22. Mrz. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	1.267,99	USD	6,334874
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.139,26	USD	7,484116
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.708,88	SGD	9,713934
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	442.610,60	USD	31,065015

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 31. März 2024 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 1,07885 US-Dollar

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse A Thes.	19	1,25 %	Klasse IF Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes.	1.582	2,89 %	Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse E Thes.	7.169	0,43 %	Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse E Thes. EUR	8	0,49 %	Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse IF Aussch.	n. z.#	n. z.#
Klasse IZ Thes.	22	1,38 %	Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	103.872	0,43 %
Klasse IZ Thes. EUR	8	0,48 %	Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	231.151	0,56 %
Klasse X1 Thes.	2.333	0,44 %	Klasse PI Aussch.	290.301	0,64 %
Klasse X1 Thes. EUR	26	0,44 %	Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	176.159	0,62 %
Klasse X1 Thes. GBP	385	0,43 %	Klasse Y Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	16.462	0,45 %	Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
Schroder GAIA BlueTrend			Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse A Thes.	0	0,00 %	Klasse Y1 Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes.	0	0,00 %	Klasse Y2 Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	32.578	0,09 %	Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y3 Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y3 Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse E Thes.	0	0,00 %	Klasse Y3 Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes.	309.247	1,89 %
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	1.309	0,34 %
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	30.237	0,85 %
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	8.562	1,48 %
Schroder GAIA Cat Bond			Klasse A1 Thes.	16.772	1,69 %
Klasse A Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes.	1.684.461	2,31 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	14.441	0,57 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	506.422	1,25 %
Klasse A Aussch.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	522.282	1,76 %
Klasse C Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes., in SEK abgesichert	82.215	1,33 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes.	13.509	2,48 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	262	0,29 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	39.987	1,40 %
Klasse F Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes., in SEK abgesichert	298	1,52 %
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#	Schroder GAIA Egerton Equity		
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes.	1.058.990	2,02 %
Klasse F Aussch.	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes., in GBP abgesichert	41.474	2,05 %
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes., in USD abgesichert	1.471.919	2,33 %
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse A Aussch. GBP	4.737	1,81 %
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A1 Thes.	30.013	1,78 %
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	382.571	2,11 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes.	3.374.432	2,31 %

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)			Schroder GAIA SEG US Equity (Forts.)		
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	513.300	2,33 %	Klasse R1 Thes.	112.927	1,39 %
Klasse C Thes., in USD abgesichert	2.811.782	2,61 %	Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	19.754	0,25 %
Klasse C Aussch.	30.000	2,36 %	Klasse R2 Thes.	697.164	1,66 %
Klasse C Aussch. GBP	18.464	2,31 %	Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes.	60	1,44 %	Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	556.188	0,55 %
Klasse X Thes.	45	0,00 %	Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	18.964	0,63 %
Schroder GAIA Helix			Klasse R3 Thes.	1.243.004	1,43 %
Klasse A Thes.	0	0,00 %	Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	231.159	0,34 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	91.436	1,16 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %	Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	2.703	0,76 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %	Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	25.727	0,57 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %	Schroder GAIA Sirius US Equity		
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes.	2.011.130	2,27 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	9.662	1,96 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	212.898	2,15 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes.	1.295.125	2,35 %
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	66.800	2,29 %
Klasse C1 Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	318.351	2,32 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	112.489	2,30 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1.965	2,36 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse E Thes.	602	1,80 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	18.161	1,78 %
Klasse I Thes.	n. z. [#]	n. z. [#]	Klasse X Thes.	43	2,39 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z. [#]	n. z. [#]	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	283	2,34 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse S Aussch.	0	0,00 %	Klasse C Thes.	4.366.589	2,63 %
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	45.881	1,60 %
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1.620.205	2,39 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	2.076.923	2,72 %
Schroder GAIA SEG US Equity			Klasse K Thes.	1.350.726	2,63 %
Klasse C Thes.	33.323	5,91 %	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	923	1,17 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	2.986	4,14 %	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	107.819	1,89 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	38.922	5,29 %			
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	178.543	5,74 %			
Klasse IZ Thes.	280.572	5,07 %			
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	3.906	4,32 %			
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	202.187	4,67 %			
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	574	4,43 %			
Klasse K Thes.	68	4,42 %			
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	419	3,64 %			
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	450	4,07 %			
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	557	4,31 %			

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %

Gesamtkostenquote („TER“)

für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Asian Equity Long Short		Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)	
Klasse A Thes.	2,31 %	Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	1,32 %
Klasse C Thes.	1,47 %	Klasse IF Aussch.	1,32 %
Klasse E Thes.	1,14 %	Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	0,62 %
Klasse E Thes. EUR	0,98 %	Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	0,62 %
Klasse I Thes.	0,15 %	Klasse PI Aussch.	0,60 %
Klasse IZ Thes.	1,19 %	Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	0,62 %
Klasse IZ Thes. EUR	1,00 %	Klasse Y Thes.	1,07 %
Klasse X1 Thes.	1,00 %	Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	1,10 %
Klasse X1 Thes. EUR	1,00 %	Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	1,11 %
Klasse X1 Thes. GBP	1,01 %	Klasse Y1 Thes.	1,48 %
Klasse X1 Thes. in GBP abgesichert	1,01 %	Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	1,53 %
Schroder GAIA BlueTrend		Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	1,52 %
Klasse A Thes.	2,01 %	Klasse Y2 Thes.	0,50 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,03 %	Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	0,53 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,03 %	Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	0,53 %
Klasse C Thes.	1,40 %	Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	0,53 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,43 %	Klasse Y3 Thes.	0,88 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43 %	Klasse Y3 Thes., in CHF abgesichert	0,91 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,43 %	Klasse Y3 Thes., in EUR abgesichert	0,91 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,43 %	Schroder GAIA Contour Tech Equity	
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,43 %	Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse E Thes.	1,40 %	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,43 %	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,43 %	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46 %
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	1,43 %	Klasse A1 Thes.	2,92 %
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	1,43 %	Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	1,45 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,72 %
Schroder GAIA Cat Bond		Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse A Thes.	1,77 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,71 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	1,82 %	Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,71 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	1,82 %	Klasse E Thes.	1,43 %
Klasse A Aussch.	1,82 %	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,46 %
Klasse C Thes.	1,38 %	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,46 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,41 %	Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1,42 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,41 %	Schroder GAIA Egerton Equity	
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,40 %	Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse F Thes.	1,73 %	Klasse A Thes., in GBP abgesichert	2,46 %
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	1,74 %	Klasse A Thes., in USD abgesichert	2,46 %
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	1,74 %	Klasse A Aussch. GBP	2,45 %
Klasse F Aussch.	1,73 %	Klasse A1 Thes.	2,93 %
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1,74 %	Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	2,96 %
Klasse I Thes.	0,14 %	Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	0,15 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,71 %
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	0,16 %	Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,71 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,17 %	Klasse C Aussch.	1,68 %
Klasse IF Thes.	1,33 %	Klasse C Aussch. GBP	1,68 %
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	1,32 %	Klasse E Thes.	1,69 %
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	1,34 %	Klasse X Thes.	1,56 %

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

Gesamtkostenquote (TER, Total Expense Ratio) für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Helix	
Klasse A Thes.	2,44 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,47 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	2,48 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,47 %
Klasse C Thes.	1,39 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,42 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,42 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,07 %
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	1,40 %
Klasse C1 Thes.	1,35 %
Klasse E Thes.	1,00 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,98 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,98 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,00 %
Klasse I Thes.	0,15 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,13 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,16 %
Klasse S Aussch.	0,57 %
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0,63 %
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0,60 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,78 %
Schroder GAIA Oaktree Credit	
Klasse A2 Thes.	1,57 %
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	1,59 %
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	1,59 %
Klasse A2 Aussch.	1,50 %
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	1,59 %
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	1,59 %
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	1,57 %
Klasse C Thes.	1,05 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,08 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,08 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,07 %
Klasse C Aussch.	0,97 %
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	1,09 %
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	1,08 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,07 %
Klasse E Thes.	0,90 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,94 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,93 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,96 %
Klasse E Aussch.	0,95 %
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	0,94 %
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	0,93 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0,93 %
Klasse I Thes.	0,14 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA SEG US Equity	
Klasse C Thes.	1,42 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,42 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,42 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,42 %
Klasse IZ Thes.	1,41 %
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	1,17 %
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,42 %
Klasse K Thes.	2,04 %
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	1,92 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	1,92 %
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	1,92 %
Klasse R1 Thes.	1,77 %
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	1,77 %
Klasse R2 Thes.	1,17 %
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	1,17 %
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	1,17 %
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	1,17 %
Klasse R3 Thes.	1,61 %
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	1,42 %
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	1,42 %
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	1,42 %
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	2,33 %
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	1,17 %
Schroder GAIA Sirios US Equity	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse C Thes.	1,68 %
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	1,72 %
Klasse E Thes.	1,36 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,41 %
Klasse X Thes.	1,52 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	1,60 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Klasse C Thes.	1,81 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,85 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,84 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,83 %
Klasse K Thes.	2,33 %
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,36 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,34 %

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

Gesamtkostenquote (TER, Total Expense Ratio) für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46 %
Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,71 %
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1,71 %
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse E Thes.	1,18 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,21 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,21 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,21 %

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäß Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäß Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total-Return-Swaps für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024 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
11.922.590	2,59 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
7.338.605	1,60 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
19.261.195	4,19 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Morgan Stanley	7.692.740
J.P. Morgan	7.275.777
Goldman Sachs	2.836.062
Merrill Lynch	1.456.616
	19.261.195

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	6.959.927
	6.959.927

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
Weniger als 1 Tag	6.959.927
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
Mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	6.959.927

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	6.959.927
	6.959.927

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	-	310.460	310.460
3 bis 12 Monate	10.263.332	4.330.485	14.593.817
Mehr als 1 Jahr	1.659.258	2.697.660	4.356.918
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	11.922.590	7.338.605	19.261.195

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	6.959.927
	6.959.927

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert EUR
Getrennt	25.407.336
Gepoolt	-
Sonstige	-
	25.407.336

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

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	5.901.362

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
6.502.975	2,30 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
6.502.975	2,30 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2024 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	2.582.217
J.P. Morgan	2.181.596
Morgan Stanley	1.652.070
Barclays Bank	87.092
	6.502.975

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	1.320.000
	1.320.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	1.320.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	1.320.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1.320.000
	1.320.000

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	-	6.502.975	6.502.975
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	-	6.502.975	6.502.975

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	1.320.000
	1.320.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

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	2.380.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	2.380.000

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

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	60.973.782

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Sirius US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
1.874.291	1,00 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
3.728.740	1,97 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
5.603.031	2,97 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Merrill Lynch	3.615.661
Goldman Sachs	1.437.620
Morgan Stanley	549.750
	5.603.031

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	100.000
	100.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	100.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	100.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	100.000
	100.000

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	-	26.132	26.132
1 bis 3 Monate	1.463.983	1.153.480	2.617.463
3 bis 12 Monate	190.552	1.819.835	2.010.387
Mehr als 1 Jahr	219.756	729.293	949.049
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	1.874.291	3.728.740	5.603.031

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Merrill Lynch	USA
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.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	100.000
	100.000

Gestellte Sicherheiten

Zum 31. März 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	5.443.133

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4.972.678	1,29 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
-	-
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
4.972.678	1,29 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	4.972.678
	4.972.678

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	3.359.187
	3.359.187

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	3.359.187
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	3.359.187

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	3.359.187
	3.359.187

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	4.972.678	-	4.972.678
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	4.972.678	-	4.972.678

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	3.359.187
	3.359.187

Gestellte Sicherheiten

Zum 31. März 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	46.623.282

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
2.769.006	0,87 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
5.323.195	1,67 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
8.092.201	2,54 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	4.406.913
J.P. Morgan	2.469.637
Goldman Sachs	1.215.651
	8.092.201

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2024 lagen keine aggregierten Transaktionsdaten für im Zusammenhang mit Total Return Swaps empfangene Sicherheiten vor.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	11.561	9.227	20.788
1 bis 4 Wochen	5.864	–	5.864
1 bis 3 Monate	–	187.734	187.734
3 bis 12 Monate	22.702	32.315	55.017
Mehr als 1 Jahr	2.728.879	5.093.919	7.822.798
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	2.769.006	5.323.195	8.092.201

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 31. März 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

Zum 31. März 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	11.313.977

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

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

GAIA 31. März 2024 DEDE