



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Geprüfter Jahresbericht

30. September 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.

Inhalt

Informationen für Investoren in der Schweiz	5
Verwaltungsrat	6
Verwaltung	7
Bericht des Verwaltungsrats	8
Bericht des Anlageverwalters	10
Prüfbericht	12
Statistische Informationen	15
Kombinierte Nettovermögensaufstellung	31
Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr	33
Kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr	35
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	37
Anlageportfolio	41
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	41
Schroder GAIA BlueTrend	42
Schroder GAIA Cat Bond	43
Schroder GAIA Contour Tech Equity	49
Schroder GAIA Egerton Equity	50
Schroder GAIA Helix	51
Schroder GAIA Oaktree Credit	55
Schroder GAIA SEG US Equity	62
Schroder GAIA Sirios US Equity	63
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	65
Schroder GAIA Wellington Pagosa	66
Anmerkungen zum Abschluss	72
Gesamtkostenquote („TER“)^	150
Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)	153
Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	155
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)	163
Anhang IV – Fondsperformance (ungeprüft)	193

Informationen für Investoren in der Schweiz

Schweizer Vertreter:

Schroder Investment Management (Switzerland) AG
Talstrasse 11
CH-8001 Zürich
Schweiz

Schweizer Zahlstelle:

Schroder & Co Bank AG
Talstrasse 11
CH-8001 Zürich
Schweiz

Ort, an dem die einschlägigen Unterlagen erhältlich sind

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

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-Lorenzini¹**

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
One London Wall Place
London EC2Y 5AU
Vereinigtes Königreich

- **Tim Boole**

Head of Product Management Private Equity

Schroders Capital Management (Switzerland) AG
Talstrasse 11
CH-8001 Zürich
Schweiz

- **Yves Francis²**

Independent Director

Rue du Pannebourg 67
6700 Arlon
Belgien

- **Wim Nagler³**

Head of Insurance, EMEA

Schroder Investment Management (Europe) S.A., French Branch
1, rue Euler
75008 Paris
Frankreich

¹ Marie-Jeanne Chevremont-Lorenzini trat am 27. Juni 2024 aus dem Verwaltungsrat zurück.

² Yves Francis wurde am 28. März 2024 in den Verwaltungsrat berufen.

³ Wim Nagler wurde am 27. Juni 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:

- Premier Fund Managers 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 (Singapore) Ltd hat den folgenden Untereinlageverwalter für Schroder GAIA Asian Equity Long Short bestellt:

- Schroder Investment Management Limited

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Talstrasse 11, 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.

* Der Untereinlageverwalter von Schroder GAIA Helix wurde mit Wirkung zum 15. Juni 2024 von Tellworth Investments LLP zu Premier Fund Managers Ltd geändert.

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: 4RIMT7.00000.SP.442.

Abschluss

Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 vor.

Zum Zeitpunkt dieses Berichts standen 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 betrifft das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024. Der letzte Termin, an dem die Anteilsurse berechnet wurden, war der 30. September 2024, der letzte Arbeitstag im Berichtsjahr. Der Abschluss wurde im Einklang mit den luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) erstellt.

Zum 30. September 2024 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5 760 793 489 EUR, was im Vergleich zu 4 928 621 911 EUR zum 30. September 2023 einem Anstieg von 16,88% 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 Teilfonds 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 Geschäftsjahres zum 30. September 2024 fanden sieben 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 unterliegt, die in luxemburgisches Recht umgesetzt wurde.
4. Dem vom Luxemburger Fondsverband (Association of the Luxembourg Fund Industry, „ALFI“) veröffentlichten Verhaltenskodex für luxemburgische Investmentfonds, dessen Grundsätze die Gesellschaft freiwillig übernommen hat.

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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

Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und dem nachhaltigen Investitionsziel, soweit zutreffend, finden Sie in Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

1. Neue Anteilsklassen

Während des Berichtszeitjahres wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelegt:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			
Klasse E Thes.	USD	USD	6. Dezember 2023
Klasse E Thes. EUR	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse IZ Thes. EUR	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes.	USD	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes. EUR	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes. GBP	GBP	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	6. Dezember 2023
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse A Aussch.	USD	USD	8. Dezember 2023
Klasse X Thes.	USD	USD	22. Dezember 2023
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	22. Dezember 2023
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	22. Dezember 2023
Schroder GAIA Contour Tech Equity			
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	USD	USD	20. August 2024
Schroder GAIA Two Sigma Diversified			
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	USD	USD	12. Juni 2024

Die am 22. Dezember 2023 aufgelegten Anteilsklassen Y3 Acc des Schroder GAIA Cat Bond wurden am 13. September 2024 in X Acc umbenannt. Die X-Anteilsklasse behält dieselben Merkmale und Zulassungskriterien wie die Y3-Anteilsklasse bei und die Gebührenstruktur und die ISIN-Codes blieben unverändert.

2. Auflösungen von Anteilsklassen

Die folgende Anteilsklasse wurde während des Berichtsjahres aufgelöst:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA SEG US Equity			
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	17. Juli 2024

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA
30. September 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 Zwölfmonatszeitraum war 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 (Fed) das Ende ihrer Zinserhöhungen erreicht habe und Anfang 2024 zu Zinssenkungen übergehen würde. 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.

Allerdings führten einige schwächere Beschäftigungszahlen im Frühsommer zu Befürchtungen, dass die Fed mit den Zinssenkungen möglicherweise zu lange gewartet hat, was Anlass zur Sorge über die Aussicht auf eine Konjunkturabschwächung oder sogar eine Rezession gab. Die Fed reagierte im September mit einer Zinssenkung um 50 Basispunkte (Bp.), die grösser war als die typische Bewegung um 25 Basispunkte.

In der Eurozone und in Grossbritannien war die Situation ähnlich: Mit einer höher als erwarteten Inflation wurden die Aussichten auf eine Lockerung der Geldpolitik zurückgeschraubt. Beide Zentralbanken senkten die Zinssätze in diesem Zeitraum.

Einen wichtigen Kontrast bildete jedoch Japan. Im März 2024 überarbeitete die Bank of Japan (BoJ) 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. Im Juli erhöhte die BoJ die Zinsen weiter auf 0,25%.

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. Die laufende Immobilienkrise belastete weiterhin die Stimmung. Die chinesischen Behörden reagierten im September 2024 mit einem Paket von Konjunkturmassnahmen. Dazu gehörten Zinssenkungen, die Finanzierung des Aktienmarktes und die Unterstützung des Immobiliensektors.

Auch geopolitische Risiken waren in diesem Berichtszeitraum beachtlich. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine setzte sich fort, während im Oktober 2023 ein erneuter Konflikt im Nahen Osten begann. Im Berichtszeitraum fanden weltweit zahlreiche Wahlen statt, doch konzentrierte sich die Aufmerksamkeit der Anleger weitgehend auf die im November 2024 stattfindenden Präsidentschaftswahlen in den USA.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Die globalen Aktienmärkte verzeichneten im Zwölfmonatszeitraum starke Gewinne. Dies geschah trotz gelegentlich ausgeprägter Volatilität, insbesondere Ende Juli/Anfang August.

Insgesamt wurden Aktien ebenso durch die Hoffnung auf eine weiche Landung der US-Wirtschaft wie durch die Erwartung weiterer Zinssenkungen gestützt. Auch die robusten Unternehmensgewinne in mehreren Sektoren und die Begeisterung für neue Technologien und künstliche Intelligenz (KI) unterstützten die Aktien. Allerdings trugen einige Zweifel an den wahrscheinlichen Renditen umfangreicher KI-Investitionen zur Volatilität auf den Märkten bei.

Der MSCI World Index erzielte in US-Dollar gemessen im Berichtszeitraum eine Rendite von 32,4%. Die US-Aktien lagen bei den Gewinnen an der Spitze, unterstützt durch starke Zuwächse bei einigen KI-Unternehmen. Der MSCI World Growth Index übertraf sein Substanzwerte-Pendant, obwohl einige niedriger bewertete Sektoren im Zuge der bevorstehenden Zinssenkungen eine bessere Performance zeigten.

Die Volatilität Ende Juli und Anfang August entsprang mehreren Quellen. Die Bank of Japan erhöhte die Zinssätze, während einige schwache US-Arbeitsmarktdaten die Erwartung steiler Zinssenkungen in den USA auslösten. Dies wirkte sich auf die Währungen aus und führte insbesondere zu einem kurzen, steilen Rückgang japanischer Aktien, wenngleich sie für den Berichtszeitraum insgesamt Gewinne verzeichneten.

Die Schwellenländer entwickelten sich etwas schlechter als die Industrieländer. Der MSCI EM Index erzielte in US-Dollar gemessen eine Rendite von 26,0%. Der Optimismus über die Aussichten für technologiebezogene Titel trug dazu bei, dass taiwanische Aktien eine starke Performance erzielten. Auch Aktien in Indien verzeichneten einen beachtlichen Anstieg. China war während eines grossen Teils des Berichtszeitraums ein grosser Nachzügler angesichts der Sorgen um seinen Immobiliensektor. Die Hoffnungen auf zusätzliche Konjunkturimpulse verliehen Aktien am Ende des Berichtszeitraums jedoch Auftrieb.

Rückblick auf die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere

Während des vierten Quartals 2023 überzeugte der nachlassende Inflationsdruck in den wichtigsten Volkswirtschaften die Anleger davon, dass die Zinssätze ihren Höchststand erreicht hatten, und löste bis zum Jahresende eine starke Rallye an den Anleihemärkten aus. Im ersten Halbjahr 2024 korrigierten die Marktteilnehmer jedoch ihre Erwartungen von Zinssenkungen nach unten, und die Renditen stiegen entsprechend bis zum dritten Quartal, als die Lockerung des Inflationsdrucks insbesondere in den USA erneut die Hoffnung auf Zinssenkungen schürte. Zur Erinnerung: Die Renditen bewegen sich tendenziell umgekehrt zu den Preisen.

Im Zwölfmonatszeitraum fiel die Rendite 10-jähriger US-Staatsanleihen von 4,57% auf 3,79%. Schwächere US-Arbeitsmarktzahlen veranlassten die Federal Reserve, auf ihrer Septembersitzung eine Zinssenkung um 0,5 Prozentpunkte zu sanktionieren.

Die Renditen japanischer Staatsanleihen stiegen, als die Bank of Japan ihre Negativzinspolitik aufgab und die Kosten für die Geldaufnahme im Juli auf 0,25% erhöhte. Die Rendite der 10-jährigen Staatsanleihen stieg im Laufe des Berichtszeitraums von 0,77% auf 0,86%.

Im Gegensatz dazu sank die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen von 2,84% auf 2,13%, da die Anleger damit zu rechnen begannen, dass die Europäische Zentralbank als erste grosse Zentralbank die Zinssätze senken würde. Dies geschah dann auch Anfang Juni, gefolgt von einer weiteren Senkung im September. Die Rendite für zehnjährige britische Gilts fiel von 4,44% auf 4,01%, als die Wirtschaft in der zweiten Jahreshälfte 2023 in eine technische Rezession abrutschte.

Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Rückblick auf die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere (Forts.)

Die Kreditspreads haben sich im Laufe des Zwölfmonatszeitraums deutlich verschärft, wobei sowohl der Investment-Grade- als auch der High-Yield-Markt von der starken Nachfrage der Anleger nach Neuemissionen und auf dem Sekundärmarkt profitierten. Am deutlichsten war die Spreadverengung an den US-amerikanischen und europäischen Märkten für hochrentierliche Unternehmensanleihen.

Der US-Dollar verzeichnete im Juni gegenüber dem Yen ein 38-jähriges hoch, bevor er einen starken Rückgang erlebte, da die Anleger mit einem schrumpfenden Zinsunterschied zwischen den USA und Japan rechneten. Insgesamt schwächte sich der US-Dollar-Index ab und ging im dritten Quartal drastisch zurück, da sich die Erwartungen im September entschieden auf eine Senkung der US-Zinsen verlagerten.

Ausblick

Eine sanfte Landung der US-Wirtschaft scheint nach wie vor das wahrscheinlichste Ergebnis zu sein. Die steigende Arbeitslosigkeit war nicht auf Entlassungen zurückzuführen, sondern vielmehr auf eine höhere Nettozuwanderung, die die Normalisierung bei der Schaffung von Arbeitsplätzen übersteigt. Generell sind die Arbeitsmarktbedingungen ausgewogener geworden, was dazu führen sollte, dass Einstellungen und Lohnzuwachs wieder zu einem normaleren Tempo zurückkehren. Neben der weiteren Desinflation und der Verbesserung der Kreditverfügbarkeit sollte dies dazu beitragen, soliden private Konsumausgaben und damit auch die Wirtschaftstätigkeit im Allgemeinen aufrechtzuerhalten. Die Inflation hat sich weiter in die richtige Richtung bewegt, was eine stimulierende Haltung der Federal Reserve ermöglicht. Dies ist ein positiver Hintergrund für US-Aktien.

In der Eurozone hinkt die Betriebsleistung trotz des Aufschwungs im globalen Warenkreislauf weiterhin weit hinter den verbraucherorientierten Sektoren zurück. Da es den Herstellern anderswo besser geht, könnte dies auf einen strukturellen Verlust an Wettbewerbsfähigkeit hindeuten.

Chinesische Aktien erzielten am Ende des Zeitraums starke Gewinne, da einige geldpolitische Konjunkturmassnahmen angekündigt wurden und noch weitere erwartet werden. Es müssen weitere fiskalpolitische Anreizmassnahmen angekündigt werden, um die Erwartungen an das chinesische Wachstum wirklich zu ändern.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

Prüfbericht



KPMG Audit S.à r.l.
39, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

Tel.: +352 22 51 51 1
Fax: +352 22 51 71
E-Mail: info@kpmg.lu
Internet: www.kpmg.lu

An die Anteilsinhaber von
Schroder GAIA
5, rue Höhenhof,
1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg

BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE

Bericht über die Prüfung des Abschlusses

Bestätigungsvermerk

Wir haben den Jahresabschluss von Schroder GAIA und die Jahresabschlüsse aller seiner Teilfonds („der Fonds“) geprüft. Diese beinhalten die kombinierte Nettovermögensaufstellung und die Aufstellung der Anlagebestände zum 30. September 2024 sowie die kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und die kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr und die Anmerkungen zum Abschluss, einschliesslich einer Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden.

Unseres Erachtens zeigt der beiliegende Jahresabschluss ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Finanzlage von Schroder GAIA und seiner jeweiligen Teilfonds zum 30. September 2024 sowie ihrer Betriebsergebnisse und Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr im Einklang mit den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Jahresabschlusses.

Grundlage des Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung im Einklang mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über das Prüfungswesen („Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing, „ISAs“), die von der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) für Luxemburg übernommen wurden, durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs sind im Abschnitt „Verantwortung des ‚Réviseur d’entreprises agréé‘ für die Prüfung des Abschlusses“ unseres Berichts näher ausgeführt. Wir sind auch im Einklang mit dem von der CSSF für Luxemburg übernommenen International Code of Ethics for Professional Accountants, einschliesslich der International Independence Standards des International Ethics Standards Board for Accountants („IESBA Code“), zusammen mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses gelten, unabhängig vom Fonds und haben unsere sonstigen ethischen Verantwortlichkeiten im Rahmen dieser ethischen Anforderungen erfüllt. Unseres Erachtens sind die Ergebnisse aus unserer Prüfung ausreichend und geeignet, um als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk zu dienen.



Sonstige Angaben

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Angaben umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Angaben, jedoch nicht den Jahresabschluss und unseren Bericht des „réviseur d’entreprises agréé“ zu diesem Jahresabschluss.

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

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Abschlusses besteht unsere Zuständigkeit darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei abzuwägen, ob die sonstigen Informationen in wesentlicher Hinsicht mit dem Abschluss oder den Kenntnissen unvereinbar sind, die wir bei der Prüfung erlangt haben, oder ob auf sonstige Weise erhebliche Falschaussagen vorzuliegen scheinen. Wenn wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeit feststellen, dass diese sonstigen Angaben wesentliche Falschaussagen enthalten, sind wir verpflichtet, dies zu berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss

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

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

Verantwortung des „réviseur d’entreprises agréé“ für die Prüfung des Abschlusses

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

Prüfbericht (Forts.)



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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher Falschaussagen im Abschluss aufgrund von Betrug oder Irrtum, wir konzipieren auf diese Risiken ausgerichtete Prüfungsverfahren und führen diese durch und wir verschaffen uns Prüfungsnachweise, die als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk ausreichend und geeignet sind. Das Risiko, dass eine auf Betrug zurückzuführende wesentliche Falschaussage nicht aufgedeckt wird, ist höher als im Fall von Irrtümern, da im Betrugsfall Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, Falschdarstellungen oder das Ausschalten interner Kontrollmassnahmen vorliegen können;
- verschaffen wir uns ein Verständnis der für die Prüfung relevanten internen Kontrollmassnahmen, um Prüfverfahren zu konzipieren, die für die jeweilige Situation geeignet sind, jedoch nicht zum Zweck der Äusserung einer Ansicht darüber, ob die internen Kontrollmassnahmen des Fonds wirksam sind oder nicht;
- beurteilen wir die Eignung der verwendeten Rechnungslegungsmethoden und die Angemessenheit der rechnungslegungsbezogenen Schätzungen und der diesbezüglichen Angaben des Verwaltungsrats des Fonds;
- äussern wir uns zur Angemessenheit der Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung durch den Verwaltungsrat des Fonds und dazu, ob auf der Grundlage der Ergebnisse der Prüfung eine erhebliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fortführung des Fonds oder eines seiner Teilfonds erheblich in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Bericht des „réviseur d’entreprises agréé“ auf die entsprechenden Angaben im Abschluss aufmerksam zu machen oder unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, wenn diese Angaben unzulänglich sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Ergebnissen aus unserer Prüfung bis zum Datum unseres Berichts des „réviseur d’entreprises agréé“. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds nicht fortgeführt wird;
- beurteilen wir die allgemeine Darstellung, die Struktur und den Inhalt des Abschlusses einschliesslich der Offenlegungen, und wir beurteilen, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse angemessen darstellt.

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

Luxemburg, den 23. Januar 2025

KPMG Audit S.à r.l.
Cabinet de révision agréé

Ravi Beegun

Bitte beachten Sie, dass der Prüfbericht nur für die im Rahmen der gesetzlichen Prüfung unterzeichnete und bei der luxemburgischen Aufsichtsbehörde hinterlegte Fassung des Jahresabschlusses gilt, die zum 23. Januar 2025 unterzeichnet wurde.

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 30. September 2024	141 469 896	295 934 599	3 586 577 697	246 803 199	491 445 702	306 961 160
zum 30. September 2023	10 603 804	400 977 339	2 479 858 286	153 926 693	410 569 595	296 663 280
zum 30. September 2022	-	371 451 166	1 976 853 711	219 535 032	588 597 772	490 363 715
Im Umlauf befindliche Anteile*						
zum 30. September 2024						
Klasse A Thes.	15	72 395	7 360	71 537	218 387	6 590
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1 752	-	2 957	-	100
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	268 393	52 308	21 747	-	147 311
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	8 060	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	100	-	-	65
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	4 291	-	140
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	346 562	-
Klasse A Aussch.	-	-	4 668	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	2 369	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	2 512	6 783	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	80 949	-
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.	19 965	310 075	11 803	422 947	590 029	30 008
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	171 383	-	213 145	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	11 243	1 566	17 974	-	9 012
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	225 034	25 804	219 686	-	34 678
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	770 165	12 635	436 344	77 093	102 488
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	62 188	-	11
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	140
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	419 926	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	4 924	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	2 476	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	24 805	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	143 697	26 916	-	3 648	6	237 828
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	1 411	-	100
Klasse E Thes. EUR	629 115	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	5 000	-	20 102	-	1 120 627
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	139 266
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	-	119 483	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	7 562	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	999	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	5 307	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	286	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	468	-	-	-
Klasse I Thes.	100 015	-	239 905	-	-	101 341
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	28 062	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	110 641	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	-	152 730	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	50 099	-	-	-

* 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 30. September 2024						
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	481 939	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	8 099 239	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	13 573	-	-	-
Klasse IZ Thes.	15	-	-	-	-	-
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	-	44 878	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	21 428	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	39 258	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	51 695	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	319 778	-	-	-
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 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	-	-	-	-	-	691
Klasse X Thes.	-	-	73 552	-	17 477	-
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	-	-	4 399	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	7 397	-	-	576 733
Klasse X1 Thes.	12 505	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	163	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	3 805	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	291 411	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	13 376	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	787	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 001	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	31	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	29	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	22 453	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	63 649	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	41 607	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	920	-	-	-

* 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 30. September 2024	83 892 307	332 176 697	209 834 166	363 240 779	298 683 883
zum 30. September 2023	69 593 042	331 125 967	171 437 016	378 919 128	483 606 159
zum 30. September 2022	47 516 413	–	188 469 066	694 846 015	615 538 573
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 30. September 2024					
Klasse A Thes.	–	–	560 792	–	88 368
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	–	–	2 721	–	6 151
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	–	–	65 912	–	111 390
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.	10 706	–	–	–	–
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100	–	–	–	–
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	100	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch.	17	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	112	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	111	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	112	–	–	–	–
Klasse C Thes.	26 737	35 371	288 949	1 282 155	964 351
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	–	–	–	69 096	70 642
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	3 778	625	9 488	16 316	75 361
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	100	29 601	83 004	568 312	412 734
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	100	54 038	20 280	131 946	445 218
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse C Thes., in USD abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse C Aussch.	17	–	–	–	–
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	113	–	–	–	–
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	112	–	–	–	–
Klasse C Aussch. GBP	–	–	–	–	–
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	113	–	68	–	–
Klasse C1 Thes.	–	–	–	–	–
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	82
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	98
Klasse E Thes.	302 984	–	170	–	30 233
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	300	–	–	–	7 879
Klasse E Thes. EUR	–	–	–	–	–
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	134 187	–	5 229	–	85 973
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	5 502	–	–	–	35 524
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse E Aussch.	1 523	–	–	–	–
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	113	–	–	–	–
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	112	–	–	–	–
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	14 562	–	–	–	–
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	–	–	–	–	–

* 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 30. September 2024					
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	26 332	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	1 056	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	3 270	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse K Thes.	-	15	-	362 412	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	100	-	383	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	100	-	42 733	-
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.	-	30 135	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	37 863	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	266 502	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	15 762	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	493 633	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	9 165	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	240 952	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	222 493	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	37 030	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	2 386	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	7 224	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	15	-	-
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

* 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 30. September 2024						
Klasse A Thes.	110,44	110,88	1 811,96	167,30	266,56	108,89
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	89,95	-	142,00	-	93,56
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	96,16	1 169,97	149,91	-	98,08
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	258,56	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	1 078,62	-	-	816,58
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	222,88	-	104,95
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	279,99	-
Klasse A Aussch.	-	-	1 026,63	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	246,55	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	165,07	246,96	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	266,45	-
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.	111,12	115,77	1 845,11	176,28	292,40	115,33
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	136,36	-	103,92	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	94,29	1 313,25	151,88	-	99,49
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	99,86	1 445,51	157,29	-	104,05
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	110,26	129,70	134,78	281,23	111,02
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1 310,62	-	858,48
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	110,90
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	307,35	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	290,87	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	270,74	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	106,17	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5 742,87
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	103,93	118,91	-	178,67	290,29	118,84
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	154,71	-	102,26
Klasse E Thes. EUR	100,56	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	102,29	-	159,49	-	107,46
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	114,44
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1 316,58	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	109,03	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1 813,72	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 294,29	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 421,31	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1 182,72	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1 534,89	-	-	-
Klasse I Thes.	116,44	-	2 156,19	-	-	127,20
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 652,77	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 823,81	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	12 217,19	-	-	11 605,14
Klasse IF Thes.	-	-	1 895,12	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 452,59	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 601,57	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	1 104,98	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1 409,32	-	-	-
Klasse IZ Thes.	112,19	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilsklassen 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 30. September 2024						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	100,77	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	112,02
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	-	99,12	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	113,15	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	770,00	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 145,30	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 192,66	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	1 042,98	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	103,85	-	-	-
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 EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	99,57
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	89,58
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	95,65
Klasse X Thes.	-	-	1 106,05	-	289,59	-
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 071,28	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 092,81	-	-	107,50
Klasse X1 Thes.	104,14	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	100,71	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	97,72	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	103,76	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	1 259,52	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 150,43	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 202,99	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	1 248,84	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 139,52	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 191,30	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	1 326,33	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 227,73	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 278,34	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	131,30	-	-	-

* 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*					
zum 30. September 2024					
Klasse A Thes.	-	-	197,60	-	120,90
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	214,34	-	101,38
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	167,48	-	106,71
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	161,56
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.	115,15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	102,97	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	107,57	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	106,22	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	96,87	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	107,30	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	104,59	-	-	-	-
Klasse C Thes.	116,44	116,95	209,97	147,43	126,04
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	98,25	156,47
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	104,66	112,20	224,98	123,89	105,99
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	109,18	114,59	177,97	130,43	111,29
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	114,34	116,41	191,97	139,79	95,62
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	106,17	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	96,89	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	107,36	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	104,64	-	191,72	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 287,86
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 583,34
Klasse E Thes.	116,88	-	229,03	-	130,81
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	105,21	-	-	-	109,66
Klasse E Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	110,01	-	194,15	-	115,37
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	114,91	-	-	-	99,10
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	106,21	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	96,90	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	107,35	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	104,67	-	-	-	-
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.	119,93	-	-	-	-
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.	-	117,83	-	-	-

* 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 30. September 2024					
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	112,30	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	115,08	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	116,42	-	-	-
Klasse K Thes.	-	116,52	-	142,95	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	111,52	-	119,75	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	114,16	-	126,17	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	115,53	-	-	-
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.	-	178,08	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	150,41	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	174,87	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	133,68	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	179,12	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	144,53	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	279,03	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	241,77	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	184,88	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	127,11	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	1 788,65	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	139,41	-	-
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	188,75	-	-
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	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilsklassen 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*						
zum 30. September 2023						
Klasse A Thes.	103,42	119,50	1 603,53	128,56	213,37	108,15
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	110,05	-	111,54	-	96,67
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	111,25	1 052,51	115,71	-	99,01
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	204,70	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	970,81	-	-	822,56
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	173,74	-	106,07
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	221,32	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	205,50	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	127,11	198,09	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	211,16	-
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.	103,91	124,02	1 626,39	134,79	233,29	113,34
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	152,99	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	114,62	1 204,97	118,45	-	101,84
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	114,89	1 295,31	121,00	-	103,92
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	144,59	114,81	102,38	222,04	109,45
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1 010,09	-	845,57
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	110,91
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	242,23	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	232,04	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	224,88	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	142,20	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5 612,20
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	127,37	-	136,88	231,50	116,33
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	119,50	-	104,06
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	117,65	-	122,68	-	106,93
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	112,36
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1 015,76	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	146,01	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1 604,26	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 192,37	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 277,91	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1 141,02	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1 507,64	-	-	-
Klasse I Thes.	105,98	-	1 877,29	-	-	123,47
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 498,81	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 613,95	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	11 257,04	-	-	11 882,66
Klasse IF Thes.	-	-	1 669,58	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 332,56	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 434,17	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	989,64	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1 359,16	-	-	-
Klasse IZ Thes.	104,07	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilsklassen 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 30. September 2023						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	110,07
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	-	114,00	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	148,34	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	76,69	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 053,34	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 072,86	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	1 005,10	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	99,98	-	-	-
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.	-	-	-	-	-	104,97
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	95,76
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	100,68
Klasse X Thes.	-	-	-	-	232,34	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	106,69
Klasse Y Thes.	-	-	1 106,78	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 053,14	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 074,49	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	1 101,70	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 047,77	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 068,64	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	1 158,82	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 117,51	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 135,43	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	115,10	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse 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 30. September 2023					
Klasse A Thes.	-	-	163,29	-	115,02
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	183,69	-	100,39
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	140,61	-	103,17
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	156,51
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	100,32	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	93,61	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	95,41	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	97,92	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	93,07	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	100,58	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	96,76	-	-	-	-
Klasse C Thes.	101,02	95,45	172,50	133,25	119,01
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	154,49
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	94,69	94,37	192,37	114,57	104,18
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	96,54	94,97	148,62	119,12	106,80
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	99,59	95,33	158,68	126,47	90,62
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	97,91	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	93,09	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	100,63	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	96,78	-	158,63	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 197,72
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 358,13
Klasse E Thes.	101,24	-	186,03	-	122,89
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	95,04	-	-	-	107,25
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	96,93	-	160,39	-	110,14
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	99,94	-	-	-	93,45
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	97,95	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	93,09	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	100,62	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	96,81	-	-	-	-
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.	103,10	-	-	-	-
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.	-	95,49	-	-	-

* 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 30. September 2023					
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	94,43	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	94,98	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	95,37	-	-	-
Klasse K Thes.	-	95,34	-	129,35	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	94,27	-	110,78	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	94,82	-	115,04	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	95,18	-	-	-
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.	-	141,59	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	120,85	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	138,62	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	109,29	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	143,16	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	114,81	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	221,10	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	82,65	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	193,41	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	147,04	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	101,64	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	1 427,75	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	114,39	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	157,58	-	-
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	-	-	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	136,68	1 345,81	106,59	186,47	104,38
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	119,31	-	96,44	-	97,10
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	122,62	904,45	98,41	-	97,81
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	176,34	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	831,74	-	-	809,88
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	145,99	-	103,53
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	188,49	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	181,92	-
Klasse A1 Thes.	-	-	105,91	173,99	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	180,74	-
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.	140,99	1 359,56	110,92	202,35	108,26
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	153,00	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	123,52	1 050,27	101,64	-	101,24
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	125,89	1 108,69	102,15	-	101,65
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	134,97	96,60	85,13	189,75	105,29
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	851,28	-	819,62
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	107,12
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	204,77	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	201,28	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	197,59	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	133,88	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5 347,70
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	144,80	-	112,34	200,89	110,69
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	102,28	-	102,97
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	128,89	-	103,33	-	104,09
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	107,65
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	853,79	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	137,42	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1 345,70	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	1 042,57	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	1 097,83	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1 036,53	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	1 385,00	-	-	-
Klasse I Thes.	-	1 550,19	-	-	116,49
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	1 290,22	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	1 364,30	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	9 771,53	-	-	11 782,70
Klasse IF Thes.	-	1 394,92	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	1 160,68	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	1 227,01	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	843,83	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1 233,72	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	105,58

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
zum 30. September 2022					
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	124,86	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	138,79	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	965,02	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	915,99	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	918,09	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	910,70	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	91,11	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	106,99
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	100,39
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	103,83
Klasse X Thes.	-	-	-	201,33	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	103,66
Klasse Y Thes.	-	922,43	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	915,33	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	917,00	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	921,51	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	914,32	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	915,99	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	-	144,25	-	-	114,68
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	168,47	-	-	104,17
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	126,87	-	-	105,30
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	157,82
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	89,68	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	87,46	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	87,63	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	91,62	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	92,17	-	-	-	-
Klasse C Thes.	90,12	151,65	126,72	112,77	117,77
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	134,17
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	88,03	175,63	112,05	139,93	107,30
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	88,24	133,59	114,57	125,50	108,20
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	89,59	140,66	120,55	-	90,30
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,77	-
Klasse C Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	91,61	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	92,15	140,47	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 352,35
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 426,56
Klasse E Thes.	90,17	162,79	-	-	121,01
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	88,22	-	-	-	109,90
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	88,45	143,73	-	-	111,01
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	89,78	-	-	-	92,66
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	92,54	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	91,60	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	92,15	-	-	-	-
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.	91,14	-	-	121,56	-
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., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
zum 30. September 2022					
Klasse K Thes.	-	-	123,20	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	108,88	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	111,19	121,97	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	147,12	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	112,71	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	125,53	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,74	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	100,54	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	141,45	-	-	-
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	-	-	-	-	-

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

Kombinierte Nettovermögensaufstellung zum 30. September 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
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	129 391 424	226 468 950	3 345 563 466	183 864 229	340 538 087	246 476 217
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	2 984 719	(23 252 194)	29 653 672	35 445 972	88 273 622	24 578 563
Wertpapiere zum Marktwert	132 376 143	203 216 756	3 375 217 138	219 310 201	428 811 709	271 054 780
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	1 122 254	4 951 287	11 731 396	1 324 293	1 686 158	6 327 155
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	2 737 273	-	-	-	264 784
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	14 934 941	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	(2 435 723)	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	2 364 423	(23 190 871)
aus Differenzkontrakten	(3 646 720)	654 764	-	(5 129 464)	-	9 140 132
	(2 524 466)	20 842 542	11 731 396	(3 805 171)	4 050 581	(7 458 800)
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	2 212 427	361	5 852 451	881 597	14 219 673
Bankguthaben	15 479 219	28 619 765	163 115 288	30 155 362	32 473 043	26 429 990
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	9 929 116	-	-	-	2 150 629
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	3 085 239	32 310 835	-	9 041 973	43 975 067	7 529 398
Forderungen aus Zeichnungen	33 992 478	209 769	9 319 355	1 275 337	2 677 265	373 634
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	126 968	-	139 345
Dividenden und Zinsforderungen	560 187	1 231 063	51 350 181	349 412	692 167	3 873 725
Erstattungsforderung des Fonds	-	223 673	33 336	-	-	17 919
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	100 000	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	50 000	250 000	3 850 000	580 184	-	70 000
Sonstige Forderungen*	905 483	-	-	630 184	1 240 450	46 946
SUMME VERMÖGENSWERTE	183 924 283	299 045 946	3 614 617 055	263 516 901	514 901 879	318 447 239
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	41 201 886	449 056	257 506	1 709 227	8 985 312	8 237 771
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	1 036 261	1 444 279	8 070 701	2 303 290	103 309	1 884 330
Fällige Managementgebühren	66 943	273 534	2 221 300	264 181	619 840	201 163
Fällige Performancegebühren	7 669	5 461	1 960 336	11 404 180	12 881 888	-
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	40 005	64 584	-	310 366	66 088	458 288
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	-
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	6 080 000	-	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	50 000	250 000	3 850 000	580 184	-	70 000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	100 000	-
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen**	51 623	624 433	5 599 515	142 274	699 740	634 527
SUMME VERBINDLICHKEITEN	42 454 387	3 111 347	28 039 358	16 713 702	23 456 177	11 486 079
SUMME NETTOVERMÖGEN	141 469 896	295 934 599	3 586 577 697	246 803 199	491 445 702	306 961 160

* 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 begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Nettovermögensaufstellung zum 30. September 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	78 369 050	263 925 541	142 359 623	5 164 828	257 325 809	4 723 513 630
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	3 134 096	32 791 053	40 887 563	(45 651)	9 198 344	227 856 015
Wertpapiere zum Marktwert	81 503 146	296 716 594	183 247 186	5 119 177	266 524 153	4 951 369 645
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	(723 698)	753 763	(55 669)	951 651	797 139	26 102 966
aus Kassageschäften	-	-	-	714	-	641
aus Terminkontrakten	76 928	-	-	(202 693)	(3 843)	2 580 467
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(28 112)	(56 709)	13 340 628
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	12 991	11 671
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(183 756)	(165 077)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	1 092 413	(1 206 765)
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(2 843 200)	(5 568 297)	(1 341 744)	(27 230 971)
aus Differenzkontrakten	-	4 192 841	-	-	-	4 681 806
	(646 770)	4 946 604	(2 898 869)	(4 846 737)	316 491	18 115 366
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	192 163	50 927	2 257 684	222 890 679	8 030 936	230 596 645
Bankguthaben	1 794 259	25 476 930	31 645 063	116 892 540	31 852 720	456 010 881
Termineinlagen	-	-	-	234 000 000	-	210 214 261
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	14 683 006	3 270 498	26 980 415
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	142 120	7 918 060	3 610 000	9 720 386	3 046 638	112 613 301
Forderungen aus Zeichnungen	217 700	595 935	224 934	10 612 881	996 972	54 619 048
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	4 649 678	450 840	-	1 250 136	5 944 360
Dividenden und Zinsforderungen	1 347 094	821 225	254 128	130 767	790 943	55 229 950
Erstattungsforderung des Fonds	-	50 251	-	-	-	292 125
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	100 000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	10 000	-	20 000	160 000	190 000	4 653 626
Sonstige Forderungen**	-	-	-	-	366 993	2 991 882
SUMME VERMÖGENSWERTE	84 559 712	341 226 204	218 810 966	609 362 699	316 636 480	6 129 731 505
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	464 003	5 072 111	929 462	234 039 656	15 682 176	285 716 085
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	43 213	270 467	619 283	484 483	824 390	15 357 944
Fällige Managementgebühren	30 939	349 646	295 194	449 371	321 804	4 639 132
Fällige Performancegebühren	-	2 347 790	6 611 211	10 012 840	-	41 943 100
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	301 675	312 165	623 215	759 772	2 644 420
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	12	-	-	-	-	11
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	5 461 977
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	10 000	-	20 000	160 000	190 000	4 653 626
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	100 000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen***	119 238	707 818	189 485	352 355	174 455	8 421 721
SUMME VERBINDLICHKEITEN	667 405	9 049 507	8 976 800	246 121 920	17 952 597	368 938 016
SUMME NETTOVERMÖGEN	83 892 307	332 176 697	209 834 166	363 240 779	298 683 883	5 760 793 489

* Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,11315 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 begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 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^	1 234 373	340 435	–	–	3 629 154	14 738 369
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	–	2 405 558	143 795 116	–	–	694 520
Nettoertrag aus Swaps	957 602	5 279 890	–	7 491 829	1 128 293	6 714 494
Bankzinsen	157 424	4 212 658	12 390 559	1 706 863	2 417 285	1 944 681
Sonstige Erträge	–	83	–	–	161	871
SUMME ERTRÄGE	2 349 399	12 238 624	156 185 675	9 198 692	7 174 893	24 092 935
AUFWAND						
Performancegebühren	7 669	5 461	1 960 336	11 404 181	13 271 831	–
Managementgebühren	271 644	3 612 017	24 891 810	2 652 882	6 688 444	2 214 273
Nettodividendenaufwand^	–	–	–	2 025 423	–	–
Nettoaufwand aus Swaps	–	–	–	–	–	–
Verwahrstellengebühren	12 478	267 447	805 330	53 988	150 040	104 696
Verwaltungsgebühren	62 597	1 071 042	4 469 234	640 639	1 412 552	367 969
Taxe d'abonnement	15 037	162 465	457 553	106 095	228 039	106 926
Vertriebsgebühren	–	–	–	3 513	103 353	–
Bank- und Zinskosten	3 003	3 545	5 512	67	1 895	10 381
Sonstige Aufwendungen	14 480	259 594	1 028 238	109 155	1 435 191	174 238
SUMME AUFWAND	386 908	5 381 571	33 618 013	16 995 943	23 291 345	2 978 483
Abzüglich: Kostenzuschüsse	–	223 673	33 336	–	–	17 919
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	1 962 491	7 080 726	122 600 998	(7 797 251)	(16 116 452)	21 132 371

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

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 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	43 392	581 602	259 650	–	19 100 952
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	5 457 924	–	78 248	12 491 728	801 026	148 878 519
Nettoertrag aus Swaps	–	646 106	1 003 354	–	493 253	21 418 935
Bankzinsen	146 787	1 807 414	1 131 725	6 882 835	2 108 418	31 604 155
Sonstige Erträge	49 999	60 827	129	–	566	101 203
SUMME ERTRÄGE	5 679 320	2 557 739	2 795 058	19 634 213	3 403 263	221 103 764
AUFWAND						
Performancegebühren	–	2 347 790	6 611 211	10 012 840	–	42 333 043
Managementgebühren	369 716	4 268 714	3 147 167	5 687 111	4 434 162	52 998 013
Nettodividendenaufwand^	–	–	–	–	64 608	1 877 583
Nettoaufwand aus Swaps	–	–	–	20 094 038	–	18 051 510
Verwahrstellengebühren	64 087	84 920	50 920	105 015	152 898	1 678 836
Verwaltungsgebühren	121 140	475 018	596 562	1 195 164	1 102 933	10 487 967
Taxe d'abonnement	30 116	104 752	96 767	185 506	160 442	1 508 782
Vertriebsgebühren	–	–	–	–	–	106 509
Bank- und Zinskosten	65 443	785	3 485	–	8 788	92 637
Sonstige Aufwendungen	31 186	144 149	81 886	109 063	309 299	3 466 622
SUMME AUFWAND	681 688	7 426 128	10 587 998	37 388 737	6 233 130	132 601 502
Abzüglich: Kostenzuschüsse	–	37 955	–	–	–	281 079
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	4 997 632	(4 830 434)	(7 792 940)	(17 754 524)	(2 829 867)	88 783 341

* 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 dem folgenden Wechselkurs vom 30. September 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,11315 US-Dollar.

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

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 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)*	1 962 491	7 080 726	122 600 998	(7 797 251)	(16 116 452)	21 132 371
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	1 304 918	(2 672 890)	598 067	48 706 148	53 724 349	21 981 499
aus Devisenterminkontrakten	2 051 458	(8 764 642)	77 240 882	6 703 651	2 882 050	5 328 689
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(8 690 748)	-	-	-	(15 265 959)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	(7 332 270)	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	8 295 014	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	8 269 112	(64 854 043)
aus Differenzkontrakten	(2 027 349)	-	-	(2 733 362)	-	28 125 364
aus Versicherungsprämien	-	-	175 939 554	-	-	-
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	4 373 120	-	1 245 153	-	(144 216)
aus Devisengeschäften	(54 414)	(281 303)	(998 702)	82 693	(1 771 572)	(3 989 140)
REALISierter NETTogewinn/(-VERLUST)	1 274 613	(15 073 719)	252 779 801	54 004 283	63 103 939	(28 817 806)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	2 882 616	830 491	103 887 242	25 055 670	46 173 534	31 691 165
aus Devisenterminkontrakten	1 248 265	6 418 093	5 311 049	1 630 734	4 385 815	9 316 478
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(4 798 223)	-	-	-	(2 089 822)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	9 174 256	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	(11 656 188)	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	(6 635 921)	(32 278 607)
aus Differenzkontrakten	(3 822 279)	504 583	-	(7 332 058)	-	16 308 709
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	(9 970)	-	(255 617)	-	(81 976)
aus Devisengeschäften	(85 836)	749 830	8 041	(2 473)	(12 481)	1 496 077
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	222 766	1 212 872	109 206 332	19 096 256	43 910 947	24 362 024
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	3 459 870	(6 780 121)	484 587 131	65 303 288	90 898 434	16 676 589
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	132 952 734	50 445 029	1 238 109 427	138 984 210	139 137 043	91 386 413
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(5 546 512)	(148 257 707)	(605 791 359)	(111 410 992)	(149 159 370)	(97 757 458)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(449 941)	(10 185 788)	-	-	(7 664)
ZUWACHS/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES	130 866 092	(105 042 740)	1 106 719 411	92 876 506	80 876 107	10 297 880
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	10 603 804	400 977 339	2 479 858 286	153 926 693	410 569 595	296 663 280
Nennwährungsanpassung**	-	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	141 469 896	295 934 599	3 586 577 697	246 803 199	491 445 702	306 961 160

* 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 30. September 2024.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 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)**	4 997 632	(4 830 434)	(7 792 940)	(17 754 524)	(2 829 867)	88 783 341
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	751 668	20 030 431	24 047 299	(310)	37 647 845	190 628 343
aus Devisenterminkontrakten	1 711 351	5 247 721	(347 576)	6 331 299	8 524 424	96 335 097
aus Kassageschäften	-	-	-	(94 008)	-	(84 452)
aus Terminkontrakten	101 511	-	-	7 834 650	40 585	(14 355 623)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(1 343 845)	(1 207 245)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	846 660	(526 109)	(6 298 989)
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	8 018	7 203
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(102 575)	(92 148)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(2 744 015)	4 986 749
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(2 304 543)	58 938 737	(8 450 137)	(6 706 396)
aus Differenzkontrakten	-	11 693 112	-	-	-	31 494 197
aus Versicherungsprämien	-	-	-	-	-	158 055 569
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	3 254 198	(129 344)	-	(960 891)	6 861 627
aus Devisengeschäften	106 676	(222)	(3 978)	33 778	(1 871 375)	(8 038 461)
REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST)	2 671 206	40 225 240	21 261 858	73 890 806	30 221 925	451 585 471
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	6 022 022	43 601 898	29 227 917	13 993	1 677 958	266 171 717
aus Devisenterminkontrakten	(1 974 406)	2 195 464	(185 513)	1 322 213	132 742	27 217 524
aus Kassageschäften	-	-	-	(16 773)	-	(15 068)
aus Terminkontrakten	76 928	-	-	(3 417 267)	(392 647)	(9 541 421)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	854 319	767 479
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	79 516	196 175	8 489 375
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	(6 453)	(5 797)
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(374 515)	(336 445)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	1 706 843	(8 938 009)
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(5 046 520)	(10 415 064)	(2 699 688)	(51 948 662)
aus Differenzkontrakten	-	2 425 320	-	-	-	7 262 522
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	1 536 178	10 812	-	(478 018)	648 077
aus Devisengeschäften	(950)	64	1 258	126 534	405 139	2 410 987
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	4 123 594	49 758 924	24 007 954	(12 306 848)	1 021 855	242 182 279
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	11 792 432	85 153 730	37 476 872	43 829 434	28 413 913	782 551 091
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	14 378 762	86 358 782	24 482 637	151 072 930	61 274 558	1 926 358 458
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(11 726 541)	(170 461 782)	(23 562 359)	(210 580 713)	(274 610 747)	(1 640 158 966)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	(145 388)	-	-	-	-	(9 692 118)
ZUWACHS/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES	14 299 265	1 050 730	38 397 150	(15 678 349)	(184 922 276)	1 059 058 465
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	69 593 042	331 125 967	171 437 016	378 919 128	483 606 159	4 928 621 911
Nennwährungsanpassung ***	-	-	-	-	-	(226 886 887)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	83 892 307	332 176 697	209 834 166	363 240 779	298 683 883	5 760 793 489

* 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 dem folgenden Wechselkurs vom 30. September 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,11315 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 30. September 2024.

Die begleitenden Anmerkungen 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	52,28	68,67	91,45	–	–	22,21
Sonstige Wertpapiere						
Werbung	–	–	–	–	–	–
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	–	–	–	–	7,20	0,02
Bekleidung	3,15	–	–	–	–	2,06
Automobilhersteller	–	–	–	–	–	0,50
Autoteile und -zubehör	–	–	–	–	–	1,35
Banken	4,14	–	–	–	4,64	11,22
Getränke	–	–	–	–	–	1,02
Biotechnologie	–	–	–	–	0,39	–
Baustoffe	–	–	–	–	3,51	0,07
Chemie	–	–	–	–	–	0,54
Kohle	–	–	–	–	–	–
Gewerbliche Dienstleistungen	2,98	–	–	6,31	–	1,01
Computer	–	–	–	5,43	0,32	0,67
Kosmetik und Körperpflege	–	–	–	–	–	0,31
Vertrieb und Grosshandel	–	–	–	–	–	–
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	–	–	–	0,93	7,46	1,50
Elektrik	–	–	–	–	–	0,70
Elektrische Bauteile und Geräte	–	–	–	–	–	0,26
Elektronik	2,39	–	–	8,22	–	2,59
Energie – Alternative Energiequellen	–	–	–	–	0,59	0,06
Bau- und Ingenieurwesen	–	–	–	–	–	0,57
Unterhaltung	–	–	–	–	2,92	–
Umweltschutz	–	–	–	–	–	–
Lebensmittel	–	–	–	–	0,96	2,68
Gastronomie	–	–	–	–	0,31	–
Gas	–	–	–	–	–	0,09
Gesundheitswesen – Produkte	–	–	–	–	3,63	0,02
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	1,50	–	–	–	–	0,47
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	–	–	–	–	–	0,23
Wohngebäude-Bauträger	–	–	–	–	–	–
Heimeinrichtungsgegenstände	–	–	–	–	0,13	0,59
Haushaltswaren	1,05	–	–	–	–	0,34
Versicherung	0,82	–	2,66	–	17,67	1,72
Internet	–	–	–	11,61	15,30	0,68
Investmentgesellschaften	–	–	–	–	–	8,54
Eisen und Stahl	–	–	–	–	–	0,09
Freizeit	0,32	–	–	–	–	0,12
Beherbergungsunternehmen	–	–	–	–	0,65	–
Maschinen – Bau und Bergbau	–	–	–	1,00	1,56	0,23
Maschinen – Diversifiziert	–	–	–	–	–	–
Medien	–	–	–	4,01	–	0,07
Metallprodukte und Eisenwaren	–	–	–	–	–	–
Bergbau	–	–	–	–	–	0,66
Diverse Fertigungsbetriebe	–	–	–	–	–	0,08
Öl und Gas	–	–	–	–	–	2,31

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.)						
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	3,05	1,54
Pipelines	-	-	-	-	-	-
Immobilien	1,01	-	-	-	-	1,52
Einzelhandel	0,77	-	-	3,87	-	1,77
Halbleiter	23,16	-	-	9,88	-	16,74
Software	-	-	-	29,38	12,36	0,08
Telekommunikation	-	-	-	8,22	-	1,07
Transport	-	-	-	-	4,61	-
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	93,57	68,67	94,11	88,86	87,26	88,30
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	6,43	31,33	5,89	11,14	12,74	11,70
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	97,15	5,03	15,03	0,03	55,96
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	0,09
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	4,20	-	0,26
Bekleidung	-	-	0,03	-	0,22
Automobilhersteller	-	-	1,02	-	-
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	-
Banken	-	-	1,66	-	5,31
Getränke	-	-	0,43	-	-
Biotechnologie	-	-	-	-	2,11
Baustoffe	-	4,80	-	-	0,10
Chemie	-	-	0,16	-	-
Kohle	-	-	-	-	0,03
Gewerbliche Dienstleistungen	-	4,19	2,17	-	0,37
Computer	-	-	0,64	-	0,36
Kosmetik und Körperpflege	-	-	0,15	-	0,19
Vertrieb und Grosshandel	-	4,15	-	-	0,06
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	0,21	-	2,64
Elektrik	-	-	1,82	-	0,79
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	1,17	-	0,05
Elektronik	-	6,64	-	-	0,23
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,23
Bau- und Ingenieurwesen	-	2,93	-	-	0,02
Unterhaltung	-	8,25	-	-	0,43
Umweltschutz	-	2,43	1,97	-	-
Lebensmittel	-	-	0,13	-	0,06
Gastronomie	-	-	-	-	-
Gas	-	-	-	-	0,44
Gesundheitswesen – Produkte	-	1,55	12,58	-	0,97
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	1,53	1,63	-	1,00
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	-
Wohngebäude-Bauträger	-	-	0,06	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	6,76	-	-	0,08
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherung	-	4,80	-	-	2,39
Internet	-	4,38	6,46	-	1,15
Investmentgesellschaften	-	-	2,61	1,38	1,68
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-
Freizeit	-	-	1,17	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	0,10	-	0,13
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	6,88	-	0,27
Maschinen – Diversifiziert	-	12,71	1,09	-	0,16
Medien	-	-	-	-	0,09
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,07
Bergbau	-	-	-	-	0,44
Diverse Fertigungsbetriebe	-	4,95	-	-	0,30
Öl und Gas	-	-	-	-	5,96

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

Sonstige Wertpapiere (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	0,36
Pharmazeutika	-	-	3,17	-	1,28
Pipelines	-	-	-	-	0,60
Immobilien	-	-	0,24	-	0,51
Einzelhandel	-	5,35	1,23	-	0,50
Halbleiter	-	2,49	8,62	-	0,60
Software	-	6,38	8,32	-	0,51
Telekommunikation	-	-	0,18	-	0,12
Transport	-	-	2,20	-	0,11
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	97,15	89,32	87,33	1,41	89,23
Termineinlagen	-	-	-	64,42	-
Sonstiges Nettovermögen	2,85	10,68	12,67	34,17	10,77
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Aktien				
Indonesien			4 138 104	2,93
7 495 600	IDR	Bank Mandiri Persero	3 428 469	2,43
2 008 200	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	709 635	0,50
Philippinen			7 047 282	4,98
607 330	PHP	BDO Unibank	1 712 392	1,21
390 110	PHP	International Container Terminal Services	2 812 481	1,99
2 479 800	PHP	SM Prime Holdings	1 429 356	1,01
3 347 100	PHP	Wilcon Depot	1 093 053	0,77
Südkorea			8 250 705	5,83
118 171	KRW	Samsung Electronics	5 557 479	3,93
4 405	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	1 160 452	0,82
11 480	KRW	SK Hynix	1 532 774	1,08
Taiwan			36 847 878	26,05
574 000	TWD	ASE Technology Holding	2 738 818	1,94
102 000	TWD	Chroma ATE	1 203 830	0,85
259 000	TWD	Eclat Textile	4 460 367	3,15
102 000	TWD	MediaTek	3 787 149	2,68
62 000	TWD	Merida Industry	450 603	0,32
92 000	TWD	Nien Made Enterprise	1 482 628	1,05
203 750	TWD	Sporton International	1 406 771	0,99
633 000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	19 142 116	13,53
34 000	TWD	Voltronic Power Technology	2 175 596	1,54
Thailand			2 124 870	1,50
2 279 100	THB	Bangkok Dusit Medical Services	2 124 870	1,50
Summe Aktien			58 408 839	41,29
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			58 408 839	41,29

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA			73 967 304	52,28
6 115 000	USD	United States Treasury Bill 03/10/24, ZCP	6 113 262	4,32
6 115 000	USD	United States Treasury Bill 10/10/24, ZCP	6 107 188	4,32
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 17/10/24, ZCP	9 977 329	7,04
6 100 000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP	6 080 136	4,30
6 100 000	USD	United States Treasury Bill 31/10/24, ZCP	6 074 215	4,29
8 000 000	USD	United States Treasury Bill 07/11/24, ZCP	7 959 538	5,63
6 115 000	USD	United States Treasury Bill 14/11/24, ZCP	6 079 499	4,30
8 581 000	USD	United States Treasury Bill 21/11/24, ZCP	8 525 324	6,03
8 590 000	USD	United States Treasury Bill 29/11/24, ZCP	8 525 221	6,03
8 595 000	USD	United States Treasury Bill 05/12/24, ZCP	8 525 592	6,02
Summe Anleihen			73 967 304	52,28
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			73 967 304	52,28
Summe Kapitalanlagen			132 376 143	93,57
Sonstiges Nettovermögen			9 093 753	6,43
Nettoinventarwert			141 469 896	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Anleihen				
USA			183 609 906	62,04
15 000 000	USD	United States Treasury Note 15/10/24, 0.63%	14 975 699	5,06
39 000 000	USD	United States Treasury Note 15/11/24, 0.75%	38 805 227	13,12
37 000 000	USD	United States Treasury Note 30/11/24, 2.13%	36 841 079	12,45
7 000 000	USD	United States Treasury Note 30/11/24, 4.50%	6 997 555	2,36
2 500 000	USD	United States Treasury Note 15/12/24, 1.00%	2 481 767	0,84
29 000 000	USD	United States Treasury Note 31/01/25, 4.13%	28 953 669	9,78
16 000 000	USD	United States Treasury Note 28/02/25, 1.13%	15 785 357	5,33
3 000 000	USD	United States Treasury Note 28/02/25, 2.75%	2 980 030	1,01
3 000 000	USD	United States Treasury Note 28/02/25, 4.63%	3 002 486	1,01
2 000 000	USD	United States Treasury Note 31/03/25, 0.50%	1 962 299	0,66
1 500 000	USD	United States Treasury Note 31/03/25, 3.88%	1 496 428	0,51
30 000 000	USD	United States Treasury Note 30/04/25, 0.38%	29 328 310	9,91
Summe Anleihen			183 609 906	62,04
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			183 609 906	62,04

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Irland			19 606 850	6,63
1 146 599 434	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	19 606 850	6,63
Summe Anleihen			19 606 850	6,63
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere			19 606 850	6,63
Summe Kapitalanlagen			203 216 756	68,67
Sonstiges Nettovermögen			92 717 843	31,33
Nettoinventarwert			295 934 599	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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 Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen									
Bermuda									
33 650 000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	33 650 000	0,95	9 750 000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	10 227 750	0,29
10 263 000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	10 359 472	0,29	8 750 000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	7 929 250	0,22
2 667 000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2 665 667	0,07	6 256 000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	6 224 720	0,17
3 500 000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel	3 518 200	0,10	14 958 000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	14 955 008	0,43
500 000	USD	Bowline Re Series 2022- 1A 23/05/25, variabel	510 700	0,01	9 902 000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	9 845 559	0,27
2 500 000	USD	Citrus Re Series A 07/06/27, variabel	2 593 875	0,07	250 000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	250 650	0,01
4 500 000	USD	Citrus Re Series B 07/06/27, variabel	4 713 975	0,13	Irland				
37 102	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	15 950	-					40 616 939
11 792 000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	11 869 827	0,33					1,13
2 600 000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	2 620 020	0,07	8 750 000	EUR	King Max Re Designated Activity 06/01/27, variabel	9 725 939	0,27
5 000 000	USD	Integrity Re 12/06/28, variabel	6 500	-	30 000 000	USD	Queen Street 2023 Re DAC 08/12/25, variabel	30 891 000	0,86
13 847 717	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	12 289 848	0,34	Singapur				
12 087 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	11 742 521	0,33					70 803 751
4 380 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	4 425 114	0,12	54 825 000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	54 992 216	1,53
4 750 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4 800 350	0,13	1 125 000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/38, ZCP	1 591 423	0,04
9 000 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	8 969 850	0,25	3 000 000	USD	Phoenix 2 Re Series 24B 04/01/38, ZCP	3 273 053	0,09
4 100 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	4 089 750	0,11	4 012 000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4 625 825	0,13
11 869 471	USD	Kilimanjaro III Re 08/01/27, variabel	10 534 156	0,29	10 000 000	NZD	Totara Re 08/06/27, 13.39%	6 321 234	0,18
507 166	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel	92 837	-	Supranational				
10 000 000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	10 162 000	0,28					48 984 573
16 000 000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	16 051 200	0,46	16 750 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variabel	17 033 913	0,48
7 000 000	USD	Puerto Rico Parametric Re 07/06/27, variabel	7 345 450	0,20	9 000 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/27, variabel	9 140 850	0,25
16 500 000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	16 650 150	0,47	10 000 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 24/04/28, variabel	10 169 000	0,29
24 947 000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	25 211 438	0,71	3 000 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 24/04/28, variabel	3 020 850	0,08
12 130 000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel	12 593 366	0,35	9 520 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 24/04/28, variabel	9 619 960	0,27
Summe Anleihen								427 320 416	11,92
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind								427 320 416	11,92

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen					12 478 000	USD	Charles River Re 10/05/27, variabel	12 872 305	0,36
Bermuda					6 750 000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel	6 932 925	0,19
27 329 000	USD	2001 Cat Re 08/01/27, variabel	27 324 901	0,76	12 000 000	USD	Citrus Re Series A 07/06/26, variabel	12 550 800	0,35
11 000 000	USD	Alamo Re Series A 07/06/26, variabel	11 513 700	0,32	5 000 000	USD	Citrus Re Series B 07/06/26, variabel	5 195 500	0,14
8 740 000	USD	Alamo Re Series C 07/06/26, variabel	9 220 263	0,26	11 785 000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	12 049 573	0,34
34 826 000	USD	Alamo Re Series A 07/06/27, variabel	36 006 600	1,00	20 000 000	USD	Easton Re 08/01/27, variabel	20 131 000	0,56
4 879 000	USD	Alamo Re Series B 07/06/27, variabel	5 056 108	0,14	199 927	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	4 598	–
7 076 000	USD	Aquila Re I Series 2023- 1B 08/06/26, variabel	7 485 700	0,21	447 546	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	67 580	–
8 971 000	USD	Aquila Re I Series 2023- 1C 08/06/26, variabel	9 558 152	0,27	504 758	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	246 423	0,01
7 750 000	USD	Aquila Re I Series 2023- 1A 07/06/27, variabel	7 892 988	0,22	25 714	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP	77 787	–
6 526 000	USD	Aquila Re I Series 2023- 1B 07/06/27, variabel	6 828 154	0,19	26 409	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP	512 802	0,01
8 030 000	USD	Aragonite Re 07/04/27, variabel	8 258 454	0,23	11 300 000	USD	Eden Re II 17/03/28, ZCP	13 354 340	0,37
5 707 000	USD	Ashera Re 07/04/27, variabel	5 786 042	0,16	40 589 000	USD	Everglades Re II 13/05/27, variabel	42 381 003	1,19
5 511 000	USD	Baldwin Re 07/07/27, variabel	5 656 215	0,16	33 716 000	USD	Everglades Re II Series B 13/05/27, variabel	35 118 585	0,98
4 600 000	USD	Bayou Re Series A 26/05/26, variabel	4 898 080	0,14	17 000 000	USD	Everglades Re II Series C 13/05/27, variabel	17 770 950	0,50
2 000 000	USD	Bayou Re Series B 26/05/26, variabel	2 199 600	0,06	1 250 000	USD	Finca Re 06/06/25, variabel	1 298 000	0,04
9 283 000	USD	Bayou Re Series A 30/04/27, variabel	9 622 294	0,27	9 223 000	USD	First Coast Re IV 07/04/26, variabel	9 614 055	0,27
2 000 000	USD	Bayou Re Series B 30/04/27, variabel	2 137 100	0,06	27 020 000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	27 681 990	0,77
6 250 000	USD	Blue Ridge Re Series A 08/01/27, variabel	6 400 000	0,18	8 750 000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	9 023 875	0,25
1 500 000	USD	Blue Ridge Re Series B 08/01/27, variabel	1 545 525	0,04	2 250 000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	2 280 938	0,06
3 500 000	EUR	Blue Sky Re DAC 26/01/27, variabel	3 970 439	0,11	19 308 000	USD	FloodSmart Re Series A 11/03/26, variabel	20 329 393	0,57
19 996 000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	20 094 980	0,56	4 500 000	USD	FloodSmart Re Series B 11/03/26, variabel	4 792 950	0,13
13 500 000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	13 425 750	0,37	41 462 000	USD	FloodSmart Re Series A 12/03/27, variabel	43 642 900	1,23
6 750 000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variabel	7 013 925	0,20	10 000 000	USD	FloodSmart Re Series B 12/03/27, variabel	10 297 500	0,29
3 333 000	USD	Bowline Re 23/05/25, variabel	3 407 326	0,10	18 000 000	USD	Foundation Re IV 08/01/27, variabel	18 471 600	0,52
11 000 000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	11 222 200	0,31	9 000 000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variabel	9 277 200	0,26
8 405 000	USD	Cape Lookout Re 28/04/26, variabel	8 784 066	0,24	4 000 000	USD	Four Lakes Re 07/01/27, variabel	4 083 200	0,11
28 169 000	USD	Cape Lookout Re 05/04/27, variabel	28 781 676	0,80	1 546 766	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	610 973	0,02

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
10 000 000	USD	Fuchsia 2023-1 - London Bridge 2 PCC 06/04/27, variabel	10 566 500	0,29	5 250 000	USD	Lower Ferry Re Series A 08/07/26, variabel	5 424 825	0,15
5 750 000	USD	Galileo Re 08/01/26, variabel	5 900 075	0,16	9 750 000	USD	Lower Ferry Re Series B 08/07/26, variabel	10 086 863	0,28
13 511 000	USD	Galileo Re 07/01/28, variabel	13 946 054	0,39	2 000 000	USD	Mangrove Risk Solutions Bermuda 10/05/25, ZCP	1 889 200	0,05
12 180 000	USD	Gateway Re II 27/04/26, variabel	12 999 714	0,36	9 500 000	USD	Marlon Series A 07/06/27, variabel	9 606 400	0,27
833 000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	838 248	0,02	5 000 000	USD	Marlon Series B 07/06/27, variabel	5 300 250	0,15
1 866 569	USD	Herbie Re 08/01/26, variabel	1 399 927	0,04	10 250 000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	10 443 725	0,29
6 000 000	USD	Herbie Re 08/01/27, variabel	6 627 000	0,18	11 500 000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	11 667 900	0,33
9 000 000	USD	Herbie Re 07/01/28, variabel	8 435 700	0,24	14 750 000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	14 198 350	0,40
4 000 000	USD	Herbie Re 08/01/28, variabel	3 717 800	0,10	4 608 034	USD	Matterhorn Re 08/01/27, variabel	4 124 190	0,11
14 150 000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	13 230 250	0,37	7 600 000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7 625 843	0,21
2 250 000	USD	Hestia Re 07/04/26, variabel	2 370 600	0,07	5 250 000	USD	Mayflower Re Series A 08/07/26, variabel	5 432 700	0,15
2 250 000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/26, variabel	2 489 309	0,07	5 250 000	USD	Mayflower Re Series B 08/07/26, variabel	5 472 600	0,15
2 812 000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/28, variabel	3 192 781	0,09	6 750 000	USD	Mayflower Re 08/07/27, variabel	6 978 488	0,19
12 250 000	USD	High Point Re 06/01/27, variabel	12 550 738	0,35	15 000 000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	15 144 000	0,42
14 258 000	USD	Hypatia 08/04/26, variabel	14 911 729	0,42	14 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	14 529 200	0,41
3 500 000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	612 500	0,02	30 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	31 223 999	0,87
12 941 000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variabel	13 842 988	0,39	16 031 000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/26, variabel	16 826 138	0,47
3 215 000	USD	Integrity Re Series B 06/06/26, variabel	3 385 556	0,09	18 641 000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/26, variabel	19 696 081	0,55
1 500 000	USD	Integrity Re Series D 06/06/26, variabel	1 611 450	0,04	21 866 000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/27, variabel	22 858 716	0,64
18 043 000	USD	Kendall Re 30/04/27, variabel	18 740 362	0,52	20 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/27, variabel	20 891 000	0,58
14 857 000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	15 237 339	0,42	44 873 000	USD	Merna Reinsurance II Series C 07/07/27, variabel	47 100 943	1,32
29 844 000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	30 570 700	0,85	23 750 000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	24 253 500	0,68
14 964 000	USD	Kilimanjaro III Re 20/04/26, variabel	14 337 008	0,40	8 250 000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variabel	8 720 250	0,24
2 250 000	USD	Kilimanjaro II Re Series A 30/06/28, variabel	2 313 675	0,06	8 714 000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variabel	9 201 113	0,26
3 761 000	USD	Kilimanjaro II Re Series B 30/06/28, variabel	3 919 150	0,11					
6 906 000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variabel	7 126 992	0,20					
5 000 000	USD	Longleaf Pine Re 25/05/27, variabel	5 436 750	0,15					

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
8 289 000	USD	Mona Lisa Re 25/06/27, variabel	8 973 257	0,25	12 300 000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	12 276 630	0,34
10 962 000	USD	Montoya Re 07/04/26, variabel	11 807 170	0,33	18 750 000	USD	Sanders Re III 05/06/26, variabel	19 950 938	0,56
5 667 000	USD	Montoya Re 07/04/27, variabel	5 852 878	0,16	5 156 000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variabel	5 359 146	0,15
10 500 000	USD	Mountain Re 05/06/26, variabel	10 916 325	0,30	10 000 000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variabel	10 558 000	0,29
22 500 000	USD	Mystic Re IV Series A 08/01/25, variabel	22 641 750	0,63	37 800 000	USD	Sanders Re III 07/04/28, variabel	39 234 509	1,10
6 500 000	USD	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variabel	6 566 625	0,18	6 829 000	USD	Solomon Re 08/06/26, variabel	7 008 944	0,20
14 250 000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variabel	14 971 763	0,42	7 875 000	USD	Stabilitas Re 05/06/26, variabel	8 107 313	0,23
29 915 000	USD	Mystic Re IV 08/01/27, variabel	30 917 152	0,86	22 475 000	USD	Sutter Re Series B 19/06/26, variabel	23 282 976	0,65
6 602 000	USD	Nakama Re Series 1 09/05/28, variabel	6 617 515	0,18	12 281 000	USD	Sutter Re Series E 19/06/26, variabel	12 829 347	0,36
8 111 000	USD	Nakama Re Series 2 09/05/28, variabel	8 280 925	0,23	17 107 000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	17 151 478	0,48
3 750 000	USD	Nature Coast Re 07/12/26, variabel	3 890 438	0,11	2 708 000	USD	Titania Re 27/02/26, variabel	2 891 467	0,08
5 000 000	USD	Nature Coast Re 07/06/28, variabel	5 315 750	0,15	9 250 000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel	9 324 000	0,26
13 918 000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	14 425 311	0,40	11 975 000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel	11 984 580	0,33
10 000 000	USD	Ocelot Re 07/01/27, variabel	10 097 000	0,28	8 250 000	USD	Tomoni Re Series A 05/04/28, variabel	8 273 513	0,23
14 864 000	USD	Palm Re 07/06/27, variabel	15 520 989	0,43	6 171 000	USD	Tomoni Re Series B 05/04/28, variabel	6 291 952	0,18
27 250 000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	27 290 875	0,76	20 000 000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	20 166 000	0,56
2 250 000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2 246 625	0,06	5 000 000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	5 066 500	0,14
8 000 000	USD	Purple Re 24/04/26, variabel	8 580 800	0,24	10 433 000	USD	Torrey Pines Re Series A 05/06/26, variabel	10 662 004	0,30
9 653 000	USD	Purple Re 05/06/26, variabel	10 190 672	0,28	4 875 000	USD	Torrey Pines Re Series B 05/06/26, variabel	5 056 106	0,14
20 874 000	USD	Purple Re 07/06/27, variabel	21 558 667	0,60	3 500 000	USD	Torrey Pines Re Series C 05/06/26, variabel	3 602 200	0,10
8 250 000	USD	Ramble Re 05/03/27, variabel	8 034 675	0,22	21 500 000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/27, variabel	22 220 250	0,62
23 000 000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	22 979 300	0,64	13 000 000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/27, variabel	13 411 450	0,37
5 750 000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5 775 300	0,16	21 366 000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	21 357 454	0,60
6 500 000	USD	Sabine Re 07/04/27, variabel	6 769 750	0,19	12 250 000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	12 355 963	0,34
19 872 000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	20 001 168	0,56	5 250 000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	5 290 688	0,15
20 000 000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	20 022 000	0,56	17 500 000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variabel	18 157 125	0,51
11 500 000	USD	Sakura Re 05/01/26, variabel	12 225 650	0,34	11 250 000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variabel	11 830 500	0,33
1 468 485	USD	Sanders Re II 07/04/26, variabel	587 394	0,02	12 173 000	USD	Ursa Re Series AA 06/12/25, variabel	12 430 459	0,35

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
2 419 000	USD	Ursa Re Series C 06/12/25, variabel	2 490 844	0,07	3 750 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variabel	3 949 313	0,11
17 000 000	USD	Ursa Re Series AA 07/12/26, variabel	17 607 750	0,49	8 500 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variabel	8 847 225	0,25
23 500 000	USD	Ursa Re Series D 07/12/26, variabel	24 785 450	0,69	12 044 000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	12 063 270	0,34
3 750 000	USD	Ursa Re Series E 07/12/26, variabel	3 920 250	0,11	6 000 000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5 996 400	0,17
7 000 000	USD	Veraison Re 09/03/26, variabel	7 316 750	0,20	13 898 000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	13 838 934	0,39
14 465 000	USD	Veraison Re 08/03/27, variabel	14 735 496	0,41	5 500 000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	5 457 100	0,15
19 806 000	USD	Winston Re Series A 26/02/27, variabel	20 748 766	0,58	14 000 000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variabel	14 221 900	0,40
8 000 000	USD	Winston Re Series B 26/02/27, variabel	8 411 600	0,23	5 550 000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variabel	5 667 938	0,16
9 625 000	USD	Wrigley Re Series A 07/08/26, variabel	9 937 331	0,28	11 022 000	USD	Vitality Re XV Series A 07/01/28, variabel	11 028 062	0,31
10 043 000	USD	Wrigley Re Series B 07/08/26, variabel	10 446 729	0,29	4 620 000	USD	Vitality Re XV Series B 07/01/28, variabel	4 619 307	0,13
Kaimaninseln			190 706 988	5,32	Hongkong			15 255 501	0,43
19 500 000	USD	Fish Pond Re 08/01/27, variabel	19 899 749	0,54	11 558 000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	11 956 751	0,34
16 800 000	USD	Long Point Re IV 01/06/26, variabel	17 093 999	0,48	3 250 000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variabel	3 298 750	0,09
1 480 545	USD	Residential Reinsurance 2019 06/06/26, variabel	1 299 993	0,04	Irland			114 649 697	3,20
7 984 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	7 987 992	0,22	5 625 000	USD	Atlas Capital DAC 05/06/26, variabel	5 751 844	0,16
5 000 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	5 002 500	0,14	17 336 000	USD	Atlas Capital DAC 08/06/27, variabel	18 873 703	0,53
4 250 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3 463 750	0,10	23 500 000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	23 683 300	0,66
8 285 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	8 302 399	0,23	8 000 000	EUR	Azzurro Re II DAC 20/04/28, variabel	8 924 791	0,25
4 642 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4 669 852	0,13	19 750 000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	21 740 682	0,61
6 500 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6 532 500	0,18	3 750 000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	4 123 803	0,11
17 416 667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	17 234 662	0,47	2 042 000	EUR	Orange Capital Re DAC 08/01/27, variabel	2 265 665	0,06
4 310 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	4 222 507	0,12	13 750 000	EUR	Quercus Re DAC 08/07/27, variabel	15 165 764	0,42
6 550 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	6 405 573	0,18	4 000 000	EUR	Taranis Reinsurance DAC 21/01/28, variabel	4 586 178	0,13
2 950 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2 902 063	0,08	8 647 000	EUR	Windmill III Re DAC 05/07/28, variabel	9 533 967	0,27
					Singapur			115 703 400	3,23
					4 000 000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	1 200 000	0,03
					12 000 000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	12 751 200	0,36

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gens
5 250 000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5 634 300	0,16
21 866 000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	21 590 488	0,60
9 957 000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	10 702 357	0,30
5 000 000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	3 896 025	0,11
6 786 000	USD	Kizuna Re III 09/04/29, variabel	6 901 023	0,19
22 464 000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	22 382 007	0,63
15 000 000	USD	Nakama Re 04/04/29, variabel	15 016 500	0,42
10 000 000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	10 063 000	0,28
3 000 000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	3 024 000	0,08
2 500 000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	2 542 500	0,07
Vereinigtes Königreich			29 982 050	0,84
29 750 000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	29 982 050	0,84
USA			390 967 837	10,89
2 100 000	USD	3264 Re 08/07/27, variabel	2 199 645	0,06
14 525 000	USD	Gateway Re Series A 23/12/24, variabel	14 382 655	0,40
13 000 000	USD	Gateway Re Series C 23/12/24, variabel	12 772 500	0,36
15 000 000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	15 499 500	0,43
27 916 000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variabel	30 173 009	0,84
5 500 000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variabel	5 885 550	0,16
10 000 000	USD	Gateway Re 08/07/27, variabel	10 301 500	0,29
460 856	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7,14%	481 130	0,01
46 750 000	USD	Lightning Re 31/03/26, variabel	49 751 350	1,39
7 500 000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	7 500 000	0,21
1 050 000	USD	Residential Reinsurance 2023 06/12/24, variabel	1 033 620	0,03
8 500 000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 13 06/06/27, variabel	8 568 850	0,24
17 300 000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 14 06/06/27, variabel	17 383 040	0,48
2 031 000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 3 06/12/27, variabel	2 073 245	0,06

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
2 265 000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 5 06/12/27, variabel	2 337 820	0,07
3 750 000	USD	Residential Reinsurance 2024 06/06/28, variabel	3 704 063	0,10
521 077	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	521 077	0,01
200 000 000	USD	United States Treasury Bill 15/10/24, ZCP	199 633 433	5,56
6 500 000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	6 765 850	0,19
Summe Anleihen			2 840 623 807	79,20
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			2 840 623 807	79,20

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Bermuda				
697	USD	Voussoir Re	-	-
Supranational			95 530 340	2,66
550	USD	Voussoir Re SideCar	-	-
697	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	-	-
530	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	-	-
557	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	-	-
800	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	84 444 800	2,35
667	USD	Voussoir Re-Preference	11 085 540	0,31
Summe Aktien			95 530 340	2,66
Anleihen				
Bermuda				
4 750 000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/27, variabel	118 988	-
USA			11 623 587	0,33
12 197 930	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96%	11 618 527	0,33
1 011 906	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	5 060	-
Summe Anleihen			11 742 575	0,33
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere			107 272 915	2,99
Summe Kapitalanlagen			3 375 217 138	94,11
Sonstiges Nettovermögen			211 360 559	5,89
Nettoinventarwert			3 586 577 697	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gens
Aktien				
Israel			7 370 024	2,99
191 728	USD	Global-e Online	7 370 024	2,99
USA			211 940 177	85,87
30 766	USD	Alphabet	5 102 541	2,07
699 823	USD	AT&T	15 396 106	6,24
37 189	USD	Autodesk	10 244 826	4,15
178 000	USD	Block	11 949 140	4,84
234 086	USD	Bloom Energy	2 471 948	1,00
44 746	USD	Broadcom	7 718 685	3,13
54 851	USD	Carvana	9 550 108	3,87
19 975	USD	CyberArk Software	5 824 910	2,36
91 405	USD	HashiCorp	3 094 973	1,25
211 555	USD	HP	7 588 478	3,07
7 035	USD	HubSpot	3 739 806	1,52
169 000	USD	Marvell Technology	12 188 280	4,94
12 727	USD	Microsoft	5 476 428	2,22
14 603	USD	MongoDB	3 947 921	1,60
372 000	USD	News	9 906 360	4,01
97 620	USD	Oracle	16 634 448	6,74
46 634	USD	PayPal Holdings	3 638 851	1,47
43 250	USD	Qorvo	4 467 725	1,81
119 309	USD	Rocket	2 289 540	0,93
44 726	USD	Salesforce	12 241 953	4,96
16 000	USD	Spotify Technology	5 896 480	2,39
327 000	USD	Trimble	20 303 430	8,22
108 537	USD	Verizon Communications	4 874 397	1,98
58 000	USD	Wayfair	3 258 440	1,32
225 259	USD	Zillow Group	14 382 787	5,83
944 924	USD	ZoomInfo Technologies	9 751 616	3,95
Summe Aktien			219 310 201	88,86
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			219 310 201	88,86
Summe Kapitalanlagen			219 310 201	88,86
Sonstiges Nettovermögen			27 492 998	11,14
Nettoinventarwert			246 803 199	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermö- gen
Aktien				
Bermuda			17 198 041	3,50
70 279	USD	RenaissanceRe Holdings	17 198 041	3,50
Brasilien			4 279 702	0,87
134 689	USD	Embraer	4 279 702	0,87
Kanada			22 669 551	4,61
295 051	CAD	Canadian Pacific Kansas City	22 669 551	4,61
Dänemark			14 975 795	3,05
141 883	DKK	Novo Nordisk	14 975 795	3,05
Frankreich			18 877 406	3,84
89 424	EUR	Safran	18 877 406	3,84
Deutschland			53 784 624	10,94
64 717	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft in Muenchen	31 989 613	6,50
94 000	EUR	SAP	19 213 600	3,91
78 059	EUR	Siemens Energy	2 581 411	0,53
Indien			3 916 902	0,80
146 067	USD	ICICI Bank	3 916 902	0,80
Irland			590 106	0,12
114 695	EUR	AIB Group	590 106	0,12
Japan			4 709 927	0,96
80 600	JPY	Toyo Suisan Kaisha	4 709 927	0,96
Vereinigtes Königreich			17 937 917	3,65
67 286	USD	Flutter Entertainment	14 342 741	2,92
441 600	HKD	HSBC Holdings	3 595 176	0,73
USA			269 871 738	54,92
120 556	USD	Alphabet	18 106 956	3,68
119 818	USD	Amazon.com	20 056 316	4,09
7 585	USD	Apple	1 587 661	0,32
44 163	USD	Aramark	1 536 570	0,31
117 957	USD	Arch Capital Group	11 855 571	2,41
2 396	USD	Booking Holdings	9 066 379	1,84
5 546	USD	Chubb	1 436 833	0,29
162 156	USD	CRH	13 509 722	2,75
8 899	USD	First Citizens BancShares	14 717 346	2,99
12 940	USD	First Solar	2 899 657	0,59
100 769	USD	Fiserv	16 262 993	3,31
211 533	USD	GE HealthCare Technologies	17 834 409	3,63
22 008	USD	GE Vernova	5 041 189	1,03
72 103	USD	General Electric	12 215 051	2,49
15 489	USD	Hilton Worldwide Holdings	3 207 308	0,65
126 051	USD	Interactive Brokers Group	15 780 863	3,21
7 695	USD	Martin Marietta Materials	3 720 823	0,76

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermö- gen
23 383	USD	Mastercard	10 372 839	2,11
37 860	USD	Meta Platforms	19 469 594	3,97
65 258	USD	Microsoft	25 226 176	5,14
106 996	USD	Progressive	24 391 416	4,97
6 574	USD	SharkNinja	642 015	0,13
125 512	USD	Uber Technologies	8 474 583	1,72
4 636	USD	Vertex Pharmaceuticals	1 936 946	0,39
42 601	USD	Visa	10 522 522	2,14
Summe Aktien			428 811 709	87,26
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			428 811 709	87,26
Summe Kapitalanlagen			428 811 709	87,26
Sonstiges Nettovermögen			62 633 993	12,74
Nettoinventarwert			491 445 702	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Aktien				
Bahrain			305 694	0,10
91 611	BHD	Aluminium Bahrain BSC	305 694	0,10
Belgien			697 520	0,23
62 499	EUR	Cenergy Holdings	697 520	0,23
Brasilien			8 628 399	2,81
128 607	BRL	Azzas 2154	995 879	0,32
187 018	BRL	B3 - Brasil Bolsa Balcao	367 800	0,12
153 383	BRL	Banco Bradesco	414 031	0,13
55 862	BRL	Banco do Brasil	278 807	0,09
9 807	BRL	Centrais Eletricas Brasileiras	70 863	0,02
45 872	BRL	Equatorial Energia	273 760	0,09
76 121	BRL	Gerdau	266 978	0,09
1 053 787	BRL	Itausa	2 142 094	0,71
242 445	BRL	PRIO	1 929 035	0,63
327 093	BRL	Raia Drogasil	1 531 015	0,50
12 626	BRL	Rede D'Or Sao Luiz	71 711	0,02
7 396	BRL	Telefonica Brasil	75 810	0,02
11 740	USD	XP	210 616	0,07
Chile			144 209	0,05
3 471	CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile	144 209	0,05
China			10 670 414	3,48
58 300	CNH	China Jushi	97 963	0,03
80 400	CNH	Contemporary Amperex Technology	2 893 695	0,95
38 800	HKD	Fuyao Glass Industry Group	260 998	0,09
29 800	CNH	Hangzhou Robam Appliances	98 700	0,03
18 620	USD	Kanzhun	323 243	0,11
128 000	HKD	Lenovo Group	174 677	0,06
157 523	CNH	Midea Group	1 711 930	0,56
260 600	CNH	Sany Heavy Industry	703 011	0,23
139 008	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1 240 389	0,40
20 300	HKD	Shenzhou International Group Holdings	184 379	0,06
7 400	CNH	Sieyuan Electric	78 138	0,03
4 000	TWD	Silergy	59 153	0,02
7 000	CNH	Sungrow Power Supply	99 599	0,03
18 418	USD	Tencent Music Entertainment Group	221 937	0,07
177 300	CNH	Toly Bread	167 961	0,05
52 800	HKD	Tongcheng Travel Holdings	135 679	0,04

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
26 300	CNH	Tongwei	85 792	0,03
5 326	USD	Trip.com Group	316 524	0,10
115 300	CNH	Wanhua Chemical Group	1 504 461	0,49
24 800	CNH	Yifeng Pharmacy Chain	90 431	0,03
42 500	CNH	Zhejiang Shuanghuan Driveline	167 361	0,05
32 500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	54 393	0,02
Kolumbien			175 920	0,06
38 688	COP	Banco Davivienda	175 920	0,06
Ägypten			213 965	0,07
126 010	USD	Commercial International Bank Egypt	213 965	0,07
Griechenland			9 734 974	3,17
1 075 314	EUR	Eurobank Ergasias Services & Holdings	2 469 814	0,80
3 332	EUR	GEK TERNA	65 672	0,02
34 575	EUR	JUMBO	991 697	0,32
45 761	EUR	Metlen Energy & Metals	1 806 912	0,59
408 581	EUR	National Bank of Greece	3 500 232	1,15
210 924	EUR	Piraeus Financial Holdings	900 647	0,29
Hongkong			299 493	0,10
33 400	HKD	AIA Group	299 493	0,10
Ungarn			8 044 988	2,62
81 258	HUF	OTP Bank	4 260 954	1,39
122 526	HUF	Richter Gedeon	3 784 034	1,23
Indonesien			5 736 625	1,87
1 635 100	IDR	Bank Central Asia	1 115 086	0,36
5 808 300	IDR	Bank Mandiri Persero	2 656 702	0,88
2 440 800	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	862 502	0,28
734 600	IDR	Mayora Indah	137 798	0,04
2 796 300	IDR	Perusahaan Gas Negara	265 039	0,09
904 200	IDR	Semen Gresik Persero	226 349	0,07
784 600	IDR	Sumber Alfaria Trijaya	163 761	0,05
1 566 600	IDR	Telkom Indonesia Persero	309 388	0,10
Italien			2 523 905	0,82
28 427	EUR	Eni	434 074	0,14
595	EUR	Ferrari	278 702	0,09
56 199	EUR	FinecoBank Banca Fineco	964 334	0,31
197 718	EUR	Intesa Sanpaolo	846 795	0,28
Japan			286 344	0,09
31 100	JPY	Soracom	286 344	0,09

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Kasachstan			1 828 782	0,60
90 666	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1 593 908	0,52
2 216	USD	Kaspi.KZ	234 874	0,08
Kenia			70 025	0,02
205 300	KES	Equity Group Holdings	70 025	0,02
Mexiko			5 969 884	1,94
35 052	MXN	Arca Continental	328 972	0,11
43 992	USD	BBB Foods	1 319 760	0,43
194 786	MXN	Fomento Economico Mexicano	1 929 080	0,63
3 396	MXN	Gruma	63 211	0,02
21 845	MXN	Grupo Aeroportuario del Pacífico	380 309	0,12
297 042	MXN	Grupo Mexico	1 666 902	0,54
37 572	MXN	La Comer	75 750	0,02
99 288	MXN	Megacable Holdings	205 900	0,07
Nigeria			13 186	-
583 306	NGN	Zenith Bank	13 186	-
Peru			383 536	0,12
14 678	USD	Intercorp Financial Services	383 536	0,12
Philippinen			6 046 641	1,97
2 926 200	PHP	Ayala Land	1 911 201	0,63
304 360	PHP	BDO Unibank	858 155	0,28
240 380	PHP	International Container Terminal Services	1 733 010	0,56
7 550	PHP	SM Investments	128 803	0,04
1 630 400	PHP	SM Prime Holdings	939 762	0,31
1 456 700	PHP	Wilcon Depot	475 710	0,15
Polen			17 377 078	5,66
44 584	PLN	Alior Bank	1 077 091	0,35
23 185	PLN	Allegro.eu	210 377	0,07
9 078	PLN	Dino Polska	829 876	0,27
48 573	PLN	Grupa Pracuj	684 983	0,22
16 947	PLN	KRUK	1 960 503	0,64
978	PLN	LPP	4 025 394	1,31
181 733	PLN	ORLEN	2 646 671	0,86
216 336	PLN	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	3 156 815	1,03
151 748	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	1 664 509	0,54
9 465	PLN	Santander Bank Polska	1 120 859	0,37
Portugal			299 599	0,10
15 218	EUR	Jeronimo Martins SGPS	299 599	0,10

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Rumänien			696 284	0,23
4 258 317	RON	OMV Petrom	696 284	0,23
Slowenien			4 620 468	1,51
6 251	EUR	Krka dd Novo mesto	948 794	0,31
137 652	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	3 671 674	1,20
Südafrika			4 805 907	1,57
59 571	ZAR	Bid	1 530 542	0,50
13 446	ZAR	Impala Platinum Holdings	75 499	0,02
59 518	ZAR	Motus Holdings	419 605	0,14
103 355	ZAR	Shoprite Holdings	1 773 994	0,58
83 038	ZAR	Telkom SOC	126 972	0,04
65 032	ZAR	Tiger Brands	879 295	0,29
Südkorea			22 600 396	7,36
19 287	KRW	Hankook Tire & Technology	611 338	0,20
303	KRW	Hanwha Aerospace	68 816	0,02
336	KRW	Hanwha Industrial Solutions	8 556	-
690	KRW	Hyundai Motor	128 745	0,04
6 154	KRW	JB Financial Group	72 048	0,02
15 701	KRW	KB Financial Group	971 332	0,32
14 700	KRW	Kia	1 122 987	0,37
483	KRW	LEENO Industrial	69 807	0,02
1 420	KRW	NCSOFT	207 402	0,07
499	KRW	Park Systems	73 646	0,02
9 291	KRW	Samsung Electro-Mechanics	941 391	0,31
231 488	KRW	Samsung Electronics	10 886 681	3,54
55 194	KRW	Samsung Electronics - Preference	2 148 333	0,70
12 554	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	3 307 222	1,08
656	KRW	Samsung SDI	189 872	0,06
14 491	KRW	Shinhan Financial Group	615 011	0,20
5 931	KRW	SK Hynix	791 889	0,26
9 014	KRW	SK Telecom	385 320	0,13
Taiwan			50 909 041	16,57
120 000	TWD	Accton Technology	2 017 285	0,66
420 000	TWD	ASE Technology Holding	2 004 013	0,65
1 000	TWD	ASMedia Technology	51 033	0,02
6 000	TWD	Asustek Computer	104 846	0,03
101 000	TWD	Chroma ATE	1 192 028	0,39
22 000	TWD	Chunghwa Telecom	87 245	0,03
120 000	TWD	CTBC Financial Holding	130 441	0,04

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
4 250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	4 566	–
54 000	TWD	Delta Electronics	649 266	0,21
32 000	TWD	E Ink Holdings	296 273	0,10
123 000	TWD	Eclat Textile	2 118 244	0,69
456 000	TWD	Hon Hai Precision Industry	2 701 721	0,88
1 000	TWD	Largan Precision	80 262	0,03
155 000	TWD	MediaTek	5 754 981	1,87
52 000	TWD	Merida Industry	377 925	0,12
65 000	TWD	Nien Made Enterprise	1 047 509	0,34
4 000	TWD	Parade Technologies	96 188	0,03
4 000	TWD	Realtek Semiconductor	59 533	0,02
139 000	TWD	Sporton International	959 711	0,31
949 000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	28 698 054	9,34
36 000	TWD	Tatung	55 911	0,02
117 000	TWD	Uni-President Enterprises	322 386	0,11
313 000	TWD	United Microelectronics	532 109	0,17
23 650	TWD	Voltronic Power Technology	1 513 319	0,49
1 000	TWD	Wiwynn	54 192	0,02
Thailand			1 734 317	0,56
1 070 200	THB	Bangkok Dusit Medical Services	997 777	0,32
158 000	THB	Kasikornbank	736 540	0,24
Türkei			7 229 193	2,36
431 324	TRY	Akbank	777 177	0,25
111 459	TRY	BIM Birslesik Magazalar	1 617 899	0,53
509 234	TRY	Coca-Cola Icecek	849 040	0,28
247 140	TRY	Haci Omer Sabanci Holding	703 744	0,23
41 737	TRY	MLP Saglik Hizmetleri	399 213	0,13
189 770	TRY	TAV Havalimanlari Holding	1 386 060	0,45
1 654 145	TRY	Yapi ve Kredi Bankasi	1 496 060	0,49
Vereinigte Arabische Emirate			3 150 630	1,03
1 067 361	AED	ADNOC Drilling	1 374 522	0,45
716 709	AED	Emaar Development	1 703 476	0,56
19 416	AED	First Abu Dhabi Bank	72 632	0,02
USA			1 950 552	0,64
2 558	USD	ARM Holdings	365 820	0,12
270	USD	Goldman Sachs Group	133 680	0,04
181 288	GBP	Haleon	955 417	0,31
536	USD	Mastercard	264 677	0,09
840	USD	Visa	230 958	0,08

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Vietnam			2 384 360	0,78
338 900	VND	Asia Commercial Bank	355 248	0,12
312 900	VND	FPT	1 713 213	0,56
110 700	VND	Vietnam Dairy Products	315 899	0,10
Summe Aktien			179 532 329	58,49
Anleihen				
Argentinien			226 775	0,07
470 000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 4.13%	226 775	0,07
Brasilien			646 601	0,21
355 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B 15/05/35, 6.00%	279 841	0,09
2 096 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	366 760	0,12
Kolumbien			635 588	0,21
2 410 000 000	COP	Colombian TES 26/03/31, 7.00%	511 933	0,17
745 100 000	COP	Colombian TES 26/10/50, 7.25%	123 655	0,04
Dominikanische Republik			370 020	0,12
20 800 000	DOP	Dominican Republic International Bond 01/06/36, 10.75%	370 020	0,12
Ecuador			127 751	0,04
246 000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 5.00%	127 751	0,04
Ägypten			268 350	0,09
4 400 000	EGP	Egypt Government Bond 04/06/27, 23.87%	91 157	0,03
8 700 000	EGP	Egypt Government Bond 13/08/27, 25.32%	177 193	0,06
Lettland			318 060	0,10
250 000	EUR	Air Baltic 14/08/29, 14.50%	318 060	0,10
Mexiko			840 911	0,27
3 600 000	MXN	Mexican Bonos 26/05/33, 7.50%	164 274	0,05
9 000 000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	423 112	0,14
5 870 000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	253 525	0,08
Pakistan			184 949	0,06
230 000	USD	Pakistan Government International Bond 08/04/51, 8.88%	184 949	0,06
Südafrika			1 378 361	0,46
6 500 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	353 530	0,12

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
6 540 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	351 488	0,11
1 730 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	87 216	0,03
7 670 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9.00%	389 657	0,14
220 000	USD	Sasol Financing USA 18/03/31, 5.50%	196 470	0,06
Sri Lanka			226 025	0,07
400 000	USD	Sri Lanka Government International Bond 28/03/30, 7.55%	226 025	0,07
Supranational			295 846	0,10
140 000 000	NGN	Asian Development Bank 03/01/25, 20.00%	86 657	0,03
280 900 000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 05/04/36, ZCP	209 189	0,07
Türkei			162 821	0,05
5 600 000	TRY	Türkiye Government Bond 17/05/28, variabel	162 821	0,05
Ukraine			128 581	0,04
200 000	USD	NPC Ukrenergo 09/11/28, 6.88%	128 581	0,04
Summe Anleihen			5 810 639	1,89
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			185 342 968	60,38

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Argentinien			157 391	0,05
149 000	USD	YPF 17/01/31, 9.50%	157 391	0,05
Brasilien			160 272	0,05
187 159	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7.25%	160 272	0,05
Kolumbien			321 375	0,10
375 000	USD	Colombia Telecomunicaciones ESP 17/07/30, 4.95%	321 375	0,10
Ägypten			463 801	0,16
1 000 000	EGP	Egypt Treasury Bills 10/12/24, ZCP	19 718	0,01
24 000 000	EGP	Egypt Treasury Bills 18/03/25, ZCP	444 083	0,15

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
USA			60 971 788	19,86
13 992 300	USD	United States Treasury Bill 03/10/24, ZCP	13 988 299	4,56
5 000 000	USD	United States Treasury Bill 10/10/24, ZCP	4 993 588	1,63
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 17/10/24, ZCP	19 954 763	6,49
50 000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP	49 837	0,02
50 000	USD	United States Treasury Bill 31/10/24, ZCP	49 789	0,02
18 000 000	USD	United States Treasury Bill 07/11/24, ZCP	17 909 147	5,82
4 000 000	USD	United States Treasury Bill 14/11/24, ZCP	3 976 687	1,30
50 000	USD	United States Treasury Bill 21/11/24, ZCP	49 678	0,02
Sambia			300 999	0,10
300 000	USD	First Quantum Minerals 01/06/31, 8.63%	300 999	0,10
Summe Anleihen			62 375 626	20,32
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			62 375 626	20,32

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Luxemburg			23 336 186	7,60
100 000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	11 688 000	3,81
223	USD	Schroder ISF - China A	30 751	0,01
22 537	USD	Schroder ISF Indian Equity	11 617 435	3,78
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			23 336 186	7,60

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Vereinigtes Königreich			-	-
100 339	USD	Noventiq Holdings	-	-
Summe Aktien			-	-
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere			-	-
Summe Kapitalanlagen			271 054 780	88,30
Sonstiges Nettovermögen			35 906 380	11,70
Nettoinventarwert			306 961 160	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Anleihen				
Argentinien			30 249	0,04
29 842	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	30 249	0,04
Belgien			309 556	0,37
280 000	EUR	Ontex Group 15/07/26, 3.50%	309 556	0,37
Kanada			219 335	0,26
200 000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	219 335	0,26
China			99 691	0,12
81 000	USD	Alibaba Group Holding 01/06/31, 0.50%	99 691	0,12
Frankreich			2 399 841	2,86
300 000	EUR	Accor perpetual, variabel	370 115	0,44
23 531	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	28 037	0,03
230 000	EUR	Afflelou 25/07/29, 6.00%	263 614	0,31
300 000	EUR	Alstom perpetual, variabel	345 176	0,41
200 000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	156 555	0,19
220 000	EUR	Banijay Entertainment 01/05/29, 7.00%	258 053	0,31
200 000	EUR	Electricite de France perpetual, variabel	244 709	0,29
300 000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	340 415	0,41
285 000	EUR	Nova Alexandre III 15/07/29, variabel	311 431	0,37
36 178	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	51 160	0,06
26 396	EUR	Veolia Environnement 01/01/25, ZCP	30 576	0,04
Deutschland			1 128 457	1,35
280 000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/05/30, 7.50%	329 221	0,40
215 000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/28, 8.75%	251 776	0,30
200 000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7.50%	230 573	0,27
270 000	EUR	TUI Cruises 15/04/29, 6.25%	316 887	0,38
Irland			53 792	0,06
56 000	USD	AerCap Ireland Capital DAC 29/10/26, 2.45%	53 792	0,06
Italien			1 525 769	1,82
210 000	EUR	Cerved Group 15/02/29, variabel	228 181	0,27
100 000	EUR	DiaSorin 05/05/28, ZCP	98 260	0,12
200 000	EUR	Engineering-Ingegneria Informatica 30/09/26, 5.88%	219 124	0,26
100 000	EUR	Eni 14/09/30, 2.95%	114 377	0,14

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
290 000	EUR	IMA Industria Macchine Automatiche 15/04/29, variabel	326 904	0,38
200 000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	222 368	0,27
270 000	EUR	Rossini 31/12/29, 6.75%	316 555	0,38
Japan			145 848	0,17
68 000	USD	NTT Finance 02/07/27, 5.10%	69 661	0,08
10 000 000	JPY	Resonac Holdings 29/12/28, ZCP	76 187	0,09
Luxemburg			1 025 777	1,22
200 000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	182 974	0,22
230 000	EUR	Eurofins Scientific perpetual, variabel	271 735	0,32
205 000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6.63%	236 747	0,28
300 000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	334 321	0,40
Niederlande			886 956	1,06
300 000	GBP	Boost Newco Borrower 15/01/31, 8.50%	434 954	0,53
210 000	EUR	Odido Holding 15/01/29, 3.75%	229 817	0,27
200 000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	222 185	0,26
Spanien			1 000 199	1,19
100 000	EUR	Cellnex Telecom 05/07/28, 0.50%	119 083	0,14
170 000	EUR	Cirsa Finance International 31/07/28, 7.88%	201 234	0,24
100 000	EUR	Cirsa Finance International 15/03/29, 6.50%	116 720	0,14
290 000	EUR	Kaixo Bondco Telecom 30/09/29, 5.13%	323 509	0,38
100 000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	116 720	0,14
100 000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	122 933	0,15
Schweden			745 751	0,89
180 000	EUR	Assemblin Caverion Group 01/07/30, 6.25%	205 898	0,25
205 000	EUR	Castellum perpetual, variabel	218 863	0,26
290 000	EUR	Verisure Midholding 15/02/29, 5.25%	320 990	0,38
Vereinigtes Königreich			2 109 390	2,51
270 000	EUR	Amber Finco 15/07/29, 6.63%	315 127	0,38
280 000	EUR	Ardonagh Finco 15/02/31, 6.88%	317 234	0,38

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
200 000	GBP	British Telecommunications 20/12/83, variabel	288 839	0,34
235 000	GBP	CD&R Firefly Bidco 30/04/29, 8.63%	326 053	0,39
240 000	GBP	CPUK Finance 28/08/29, 7.88%	329 516	0,39
195 000	GBP	Heathrow Finance 01/03/31, 6.63%	261 345	0,31
215 000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5.25%	271 276	0,32
USA			2 528 236	3,02
265 000	EUR	Allied Universal 01/06/28, 3.63%	278 576	0,33
52 000	USD	Amcor Group Finance 23/05/29, 5.45%	53 913	0,06
33 000	USD	American Tower 15/01/28, 3.60%	32 207	0,04
200 000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2.13%	193 037	0,23
5 000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5.25%	3 734	-
265 000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/31, 8.50%	314 745	0,38
250 000	EUR	EMRLD Borrower 15/12/30, 6.38%	292 750	0,35
33 000	USD	Ford Motor Credit 10/08/26, 2.70%	31 720	0,04
32 000	USD	Global Payments 15/02/25, 2.65%	31 703	0,04
31 000	USD	HCA 15/06/26, 5.25%	31 238	0,04
275 000	EUR	Helios Software Holdings 01/05/29, 7.88%	311 867	0,37
100 000	EUR	Merrill Lynch 30/01/26, ZCP	112 580	0,13
52 000	USD	Mohawk Industries 18/09/28, 5.85%	54 823	0,07
190 000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5.00%	170 925	0,20
190 000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6.00%	190 516	0,23
265 000	EUR	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9.63%	317 249	0,39
54 000	USD	Oracle 01/04/25, 2.50%	53 387	0,06
54 000	USD	Stanley Black & Decker 01/03/26, 3.40%	53 266	0,06
Summe Anleihen			14 208 847	16,94
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			14 208 847	16,94

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Australien			1 032 015	1,23
60 000	USD	Mineral Resources 01/10/28, 9.25%	63 798	0,08
125 000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8.50%	130 397	0,16
177 912	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	123 284	0,15
184 703	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	127 479	0,15
405 528	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	280 228	0,33
444 148	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	306 829	0,36
Belgien			392 500	0,47
400 000	USD	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 5.50%	392 500	0,47
Bermuda			1 012 626	1,21
100 000	USD	AREIT 17/08/41, variabel	99 732	0,12
400 000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	406 073	0,48
500 000	USD	RR 24 15/01/36, variabel	506 821	0,61
Brasilien			696 550	0,83
200 000	USD	Azul Secured Finance 28/05/30, 10.88%	127 052	0,15
200 000	USD	Braskem Netherlands Finance 23/01/81, variabel	200 381	0,24
393 694	USD	Samarco Mineracao 30/06/31, 9.00%	369 117	0,44
Kanada			1 714 675	2,04
100 000	USD	Bombardier 15/02/28, 6.00%	100 712	0,12
105 000	USD	Bombardier 15/11/30, 8.75%	115 378	0,14
100 000	USD	Bombardier 01/06/32, 7.00%	104 717	0,12
405 000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	396 378	0,47
505 000	USD	Empire Communities 01/05/29, 9.75%	539 717	0,64
43 000	USD	First Majestic Silver 15/01/27, 0.38%	38 201	0,05
300 000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	298 237	0,36
121 000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	121 335	0,14

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Kaimaninseln			5 574 257	6,64
250 000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	236 462	0,28
250 000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	245 607	0,29
1 162 549	USD	Falcon Aerospace 15/09/39, 6.66%	715 271	0,85
375 000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	326 695	0,39
375 000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	366 180	0,44
250 000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	251 857	0,30
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	250 719	0,30
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	250 866	0,30
395 245	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3.97%	371 001	0,44
1 116 071	USD	Thunderbolt II Aircraft Lease 15/09/38, variabel	798 921	0,95
375 000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	376 920	0,45
1 000 000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	1 010 000	1,20
400 000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	373 758	0,45
Chile			29 104	0,03
25 000	USD	Latam Airlines Group 15/10/29, 13.38%	29 104	0,03
China			159 565	0,19
35 000	USD	H World Group 01/05/26, 3.00%	41 353	0,05
42 000	USD	JD.com 01/06/29, 0.25%	48 131	0,06
22 000	USD	Trip.com Group 15/06/29, 0.75%	25 214	0,03
42 000	USD	ZTO Express Cayman 01/09/27, 1.50%	44 867	0,05
Dänemark			48 966	0,06
42 000	USD	Ascendis Pharma 01/04/28, 2.25%	48 966	0,06
Deutschland			520 747	0,62
610 000	USD	Mercer International 01/02/29, 5.13%	520 747	0,62
Hongkong			481 521	0,57
505 000	USD	Seaspan 01/08/29, 5.50%	481 521	0,57
Indien			460 853	0,55
94 000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/27, 13.88%	94 346	0,11
168 000	USD	Vedanta Resources Finance II 09/12/28, 13.88%	168 417	0,20
Irland			8 433 059	10,06
195 000	USD	Vedanta Resources Finance II 17/09/29, 10.88%	198 090	0,24
375 000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	420 192	0,50
750 000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	832 875	1,00
550 000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	611 733	0,74
250 000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC 15/01/37, variabel	321 561	0,38
500 000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund XXXI DAC 15/06/37, variabel	564 126	0,67
101 511	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	107 997	0,13
97 560	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	125 248	0,15
106 340	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	132 575	0,16
375 000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	420 886	0,50
800 000	EUR	ICG Euro CLO DAC 19/04/36, variabel	891 988	1,07
100 000	GBP	Last Mile Logistics CMBS UK DAC 17/08/33, variabel	134 220	0,16
174 770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	185 548	0,22
550 821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	596 668	0,71
375 000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	421 680	0,50
300 000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variabel	338 498	0,40
375 000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	421 017	0,50
250 000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	277 882	0,33
310 000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variabel	414 579	0,49
191 173	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	241 526	0,29
500 000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variabel	562 248	0,67
375 000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	410 012	0,49
Japan			75 596	0,09
10 000 000	JPY	Daifuku 14/09/28, ZCP	75 596	0,09

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Jersey			1 002 692	1,20
495 000	USD	Aston Martin Capital Holdings 31/03/29, 10.00%	486 478	0,58
500 000	USD	ICG US CLO 18/07/36, variabel	516 214	0,62
Luxemburg			304 058	0,36
325 000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	304 058	0,36
Mexiko			688 524	0,82
510 610	USD	Borr IHC 15/11/28, 10.00%	530 788	0,63
200 000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%	157 736	0,19
Niederlande			54 128	0,06
53 000	USD	AEGON Funding 16/04/27, 5.50%	54 128	0,06
Schweiz			69 696	0,08
70 000	USD	UBS Group 15/04/26, 4.13%	69 696	0,08
Vereinigtes Königreich			490 728	0,58
100 000	GBP	UK Logistics DAC 17/05/34, variabel	133 291	0,16
175 000	GBP	UK Logistics DAC Series 2022-1 17/05/34, variabel	233 595	0,27
100 000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	123 842	0,15
USA			40 898 743	48,76
195 000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	195 597	0,23
300 000	USD	Acuris Finance US 01/05/28, 5.00%	274 995	0,33
34 000	USD	Advanced Energy Industries 15/09/28, 2.50%	35 955	0,04
36 000	USD	Akamai Technologies 01/09/27, 0.38%	37 251	0,04
165 000	USD	Alliant Holdings Intermediate 01/10/32, 7.38%	167 681	0,20
135 000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	126 793	0,15
485 000	USD	Allied Universal Holdco 15/02/31, 7.88%	495 941	0,59
325 000	USD	AMC Networks 15/01/29, 10.25%	334 272	0,40
275 000	USD	AMC Networks 15/02/29, 4.25%	199 167	0,24
290 000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13%	261 245	0,31
305 000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	152 458	0,18
360 000	USD	B&G Foods 15/09/28, 8.00%	377 082	0,45
71 000	USD	Bank of America 19/06/26, variabel	69 265	0,08
50 000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%	45 204	0,05
55 000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	43 092	0,05
375 000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	392 874	0,47
33 000	USD	Berry Global 15/01/26, 1.57%	31 764	0,04
267 682	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	246 892	0,29
54 000	USD	BlackLine 01/06/29, 1.00%	56 700	0,07
90 000	USD	Block Communications 01/03/28, 4.88%	85 003	0,10
595 000	USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%	557 712	0,67
135 000	USD	Boost Newco Borrower 15/01/31, 7.50%	144 982	0,17
430 000	USD	Brinker International 15/07/30, 8.25%	462 388	0,55
325 000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/27, 3.88%	310 604	0,37
270 000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	253 606	0,30
415 000	USD	Calpine 01/02/29, 4.63%	401 392	0,48
90 000	USD	Calpine 01/02/31, 5.00%	87 252	0,10
115 000	USD	Carnival 01/06/30, 10.50%	124 961	0,15
246 445	USD	Castlelake Aircraft Structured Trust 15/08/41, 2.74%	230 019	0,27
105 000	USD	CCO Holdings 01/03/30, 4.75%	96 628	0,12
80 000	USD	CCO Holdings 01/03/31, 7.38%	81 992	0,10
145 000	USD	CCO Holdings 01/05/32, 4.50%	125 467	0,15
220 000	USD	CCO Holdings 01/06/33, 4.50%	187 128	0,22
515 000	USD	Central Parent 15/06/29, 8.00%	536 203	0,64
32 000	USD	Charter Communications Operating 23/07/25, 4.91%	31 956	0,04
330 000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	330 394	0,39
285 000	USD	Clear Channel Outdoor Holdings 01/04/30, 7.88%	298 265	0,36
620 000	USD	Cloud Software Group 31/03/29, 6.50%	616 428	0,74

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
28 000	USD	CMS Energy 01/05/28, 3.38%	30 128	0,04	560 000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	555 422	0,67
68 000	USD	CNO Global Funding 04/06/27, 5.88%	70 045	0,08	100 749	USD	Five Point Operating 15/01/28, 10.50%	103 168	0,12
535 000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7.00%	544 958	0,65	33 000	USD	Fluor 15/08/29, 1.13%	40 458	0,05
141 000	USD	COLT Mortgage Loan Trust 25/02/69, variabel	143 355	0,17	400 000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	374 771	0,45
45 000	USD	CommScope 01/07/28, 7.13%	37 654	0,04	23 000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	22 598	0,03
225 000	USD	CommScope 01/09/29, 4.75%	189 281	0,23	295 000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	294 498	0,35
300 000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	290 625	0,35	170 000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/12/30, 7.88%	183 333	0,22
40 000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	39 393	0,05	80 000	USD	Freedom Mortgage 01/10/30, 12.25%	89 672	0,11
30 000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	29 149	0,03	210 000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	208 585	0,25
145 000	USD	Community Health Systems 15/02/31, 4.75%	127 645	0,15	170 000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	171 429	0,20
230 000	USD	Community Health Systems 15/01/32, 10.88%	253 806	0,30	75 000	USD	Frontier Communications Holdings 15/05/30, 8.75%	79 990	0,10
240 000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/01/32, 5.00%	221 770	0,26	69 000	USD	GA Global Funding Trust 23/09/27, 4.40%	68 846	0,08
380 000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	359 646	0,43	69 000	USD	Goldman Sachs Bank USA 18/03/27, variabel	69 909	0,08
395 000	USD	CQP 15/06/31, 5.50%	387 559	0,46	370 000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	367 401	0,44
75 000	USD	CQP Holdco 15/12/33, 7.50%	81 435	0,10	66 000	USD	Guardant Health 15/11/27, ZCP	53 140	0,06
425 000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 01/09/31, 8.88%	464 281	0,55	17 000	USD	Haemonetics 01/06/29, 2.50%	17 145	0,02
340 000	USD	CVR Energy 15/02/28, 5.75%	319 573	0,38	21 000	USD	Halozyne Therapeutics 15/08/28, 1.00%	24 990	0,03
46 250	USD	Delta Air Lines 20/10/25, 4.50%	45 982	0,05	395 000	USD	Hanesbrands 15/02/31, 9.00%	426 299	0,51
325 000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5.88%	319 464	0,38	35 000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3.38%	33 917	0,04
500 000	USD	Endo Finance Holdings 15/04/31, 8.50%	536 430	0,64	360 000	USD	Helios Software Holdings 01/05/29, 8.75%	368 245	0,44
510 000	USD	EquipmentShare.com 15/05/28, 9.00%	533 307	0,64	450 000	USD	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 01/06/29, 5.00%	427 852	0,51
75 000	USD	EquipmentShare.com 15/05/32, 8.63%	78 788	0,09	180 000	USD	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 01/07/31, 4.88%	163 508	0,19
28 000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	22 958	0,03	340 000	USD	HUB International 15/06/30, 7.25%	354 665	0,42
33 000	USD	Evolent Health 01/12/29, 3.50%	35 615	0,04					
90 000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	83 900	0,10					
285 000	USD	Fiesta Purchaser 01/03/31, 7.88%	302 632	0,36					

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
585 000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	566 443	0,69	256 125	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	254 267	0,30
405 000	USD	Imola Merger 15/05/29, 4.75%	395 865	0,47	43 000	USD	NCL 15/02/27, 1.13%	41 783	0,05
6 000	USD	Insmmed 01/06/28, 0.75%	13 779	0,02	340 000	USD	NCR Atleos 01/04/29, 9.50%	374 576	0,45
17 000	USD	Jazz Investments I 15/09/30, 3.13%	17 791	0,02	105 000	USD	NCR Voyix 01/10/28, 5.00%	103 277	0,12
345 000	USD	JB Poindexter 15/12/31, 8.75%	365 512	0,44	245 000	USD	NCR Voyix 15/04/29, 5.13%	239 968	0,29
700 000	USD	Kennedy-Wilson 01/02/30, 4.75%	635 455	0,77	305 000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4.50%	286 503	0,34
95 000	USD	Kodiak Gas Services 15/02/29, 7.25%	98 404	0,12	560 000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9.29%	549 835	0,66
320 000	USD	Kraken Oil & Gas Partners 15/08/29, 7.63%	319 856	0,38	33 000	USD	NextEra Energy Capital Holdings 01/03/27, 3.00%	43 197	0,05
125 000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	117 438	0,14	33 000	USD	Nissan Motor Acceptance 13/09/27, 5.30%	32 937	0,04
375 000	USD	LCM Investments Holdings II 01/08/31, 8.25%	398 619	0,48	33 000	USD	Nutanix 01/10/27, 0.25%	39 518	0,05
375 000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4.25%	302 320	0,36	370 000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	353 640	0,42
48 000	USD	Liberty Media-Liberty Formula One 15/08/27, 2.25%	52 988	0,06	135 000	USD	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9.75%	144 256	0,17
200 000	USD	Lightning Power 15/08/32, 7.25%	210 156	0,25	80 000	USD	Olympus Water US Holding 15/06/31, 7.25%	83 323	0,10
12 000	USD	LivaNova USA 15/12/25, 3.00%	13 227	0,02	26 000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0.50%	26 384	0,03
22 000	USD	Live Nation Entertainment 15/01/29, 3.13%	27 137	0,03	52 000	USD	Parsons 01/03/29, 2.63%	65 546	0,08
600 000	USD	Marriott Ownership Resorts 15/06/29, 4.50%	564 885	0,68	27 000	USD	Pebblebrook Hotel Trust 15/12/26, 1.75%	24 894	0,03
32 000	USD	Mattel 01/04/26, 3.38%	31 298	0,04	390 000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5.38%	378 083	0,45
340 000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5.25%	333 407	0,40	54 000	USD	Penske Truck Leasing 15/07/25, 4.00%	53 684	0,06
36 000	USD	Meritage Homes 15/05/28, 1.75%	41 166	0,05	57 000	USD	PG&E 01/12/27, 4.25%	61 802	0,07
295 000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	286 872	0,34	460 000	USD	Pike 31/01/31, 8.63%	492 420	0,59
47 000	USD	MKS Instruments 01/06/30, 1.25%	47 071	0,06	18 000	USD	PPL Capital Funding 15/03/28, 2.88%	19 112	0,02
74 000	USD	Morgan Stanley 20/07/27, variabel	70 386	0,08	480 000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	480 531	0,57
75 000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	53 801	0,06	299 299	USD	PRPM 25/06/26, variabel	297 226	0,35
375 000	USD	Nabors Industries 15/08/31, 8.88%	357 411	0,43	200 600	USD	PRPM 25/09/26, variabel	200 112	0,24
153 000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/08/28, 5.50%	151 574	0,18	100 000	USD	PRPM Trust Series 2024- B1 25/12/68, variabel	99 916	0,12
120 000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/11/31, 5.75%	117 682	0,14	120 000	USD	PRPM Trust Series 2024- M1 25/12/68, variabel	122 256	0,15
					236 000	USD	QVC 15/04/29, 6.88%	196 398	0,23
					41 000	USD	Rexford Industrial Realty 15/03/29, 4.13%	43 624	0,05

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
590 000	USD	Rocket Software 28/11/28, 9.00%	616 403	0,74
25 000	USD	Sarepta Therapeutics 15/09/27, 1.25%	28 400	0,03
495 000	USD	Service Properties Trust 15/11/31, 8.63%	538 745	0,64
45 000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	41 935	0,05
535 000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5.50%	523 270	0,62
45 000	USD	Sirius XM Radio 01/07/30, 4.13%	40 851	0,05
22 000	USD	Snowflake 01/10/27, ZCP	22 924	0,03
530 000	USD	Sotera Health Holdings 01/06/31, 7.38%	551 063	0,66
55 000	USD	Southern 15/12/25, 3.88%	61 229	0,07
295 000	USD	Spirit AeroSystems 15/11/30, 9.75%	329 284	0,39
55 000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4.75%	53 934	0,06
170 000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4.38%	161 044	0,19
110 000	USD	STL Holding 15/02/29, 8.75%	117 123	0,14
425 000	USD	Talen Energy Supply 01/06/30, 8.63%	463 619	0,55
28 000	USD	Tetra Tech 15/08/28, 2.25%	36 778	0,04
95 000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	90 557	0,11
455 000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	425 478	0,51
37 000	USD	Uber Technologies 01/12/28, 0.88%	46 417	0,06
1 042 000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP	1 038 927	1,24
165 000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7.38%	160 639	0,19
75 000	USD	Venture Global LNG 01/02/29, 9.50%	84 309	0,10
155 000	USD	Venture Global LNG 15/01/30, 7.00%	158 449	0,19
360 000	USD	Venture Global LNG 01/06/31, 8.38%	380 439	0,45
400 000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	398 759	0,48
271 000	USD	Verus Securitization Trust 25/06/68, variabel	273 353	0,33
80 743	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/08/68, variabel	82 286	0,10
1 134 000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/08/68, variabel	1 152 394	1,38

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
100 000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-M1 25/08/68, variabel	102 462	0,12
167 829	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/09/68, variabel	171 003	0,20
174 000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/09/68, variabel	177 109	0,21
100 000	USD	Vistra Operations 15/10/31, 7.75%	107 737	0,13
365 000	USD	Vital Energy 15/04/32, 7.88%	353 883	0,42
121 000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	119 998	0,14
189 000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	165 632	0,20
520 000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	475 585	0,57
185 000	USD	Wand NewCo 3 30/01/32, 7.63%	195 028	0,23
370 000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	368 456	0,44
205 000	USD	Watco 01/08/32, 7.13%	213 812	0,25
310 667	USD	WAVE Trust 15/11/42, 3.84%	285 900	0,34
31 000	USD	WEC Energy Group 01/06/29, 4.38%	34 457	0,04
70 000	USD	Wells Fargo 25/04/26, variabel	69 566	0,08
470 000	USD	Windsor Holdings III 15/06/30, 8.50%	503 302	0,60
470 000	USD	Zayo Group Holdings 01/03/27, 4.00%	420 765	0,50
Summe Anleihen			64 140 603	76,45
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			64 140 603	76,45

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Kaimaninseln			581 380	0,69
627 853	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4.46%	581 380	0,69
China			36 930	0,04
200 000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%*	10 330	0,01
200 000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%*	12 600	0,02

* Notleidendes Wertpapier.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
200 000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%*	14 000	0,01
Deutschland			173 832	0,21
155 000	EUR	Dynamo Newco II 15/10/31, 6.25%	173 832	0,21
Irland			2 361 554	2,82
750 000	EUR	Aurium CLO 18/01/38, variabel	846 403	1,02
500 000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	552 420	0,66
250 000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	284 058	0,34
500 000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	565 472	0,67
100 000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	113 201	0,13
Summe Anleihen			3 153 696	3,76
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere			3 153 696	3,76
Summe Kapitalanlagen			81 503 146	97,15
Sonstiges Nettovermögen			2 389 161	2,85
Nettoinventarwert			83 892 307	100,00

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- vermö- gen
Aktien				
USA			280 024 714	84,29
27 577	USD	Amphenol	1 796 917	0,54
153 792	USD	Brown & Brown	15 932 851	4,80
64 276	USD	CDW	14 545 659	4,38
33 337	USD	Clean Harbors	8 057 886	2,43
310 316	USD	Core & Main	13 778 030	4,15
266 704	USD	Dayforce	16 335 620	4,92
22 577	USD	EMCOR Group	9 720 076	2,93
73 572	USD	Entegris	8 279 057	2,49
56 213	USD	Garmin	9 895 174	2,98
87 968	USD	ITT	13 152 096	3,96
22 786	USD	Labcorp Holdings	5 092 215	1,53
231 963	USD	Live Nation Entertainment	25 397 630	7,64
29 592	USD	Martin Marietta Materials	15 927 894	4,80
126 109	USD	Middleby	17 545 545	5,27
18 061	USD	Paychex	2 423 606	0,73
13 392	USD	PTC	2 419 399	0,73
40 264	USD	Revvity	5 143 726	1,55
176 378	USD	Service International	13 921 516	4,19
172 588	USD	Signet Jewelers	17 800 726	5,35
7 484	USD	Teledyne Technologies	3 275 447	0,99
412 016	USD	Tempur Sealy International	22 496 074	6,76
110 639	USD	Toro	9 595 720	2,89
166 854	USD	Trimble	10 359 965	3,12
11 656	USD	Vail Resorts	2 031 524	0,61
83 074	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	15 100 361	4,55
Summe Aktien			280 024 714	84,29
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			280 024 714	84,29

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelter Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA			16 691 880	5,03
17 000 000	USD	United States Treasury Bill 20/02/25, ZCP	16 691 880	5,03
Summe Anleihen			16 691 880	5,03
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			16 691 880	5,03
Summe Kapitalanlagen			296 716 594	89,32
Sonstiges Nettovermögen			35 460 103	10,68
Nettoinventarwert			332 176 697	100,00

* Notleidendes Wertpapier.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Aktien				
Taiwan			10 436 351	4,97
60 093	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	10 436 351	4,97
Vereinigtes Königreich			252 551	0,12
3 207	USD	Coca-Cola Europacific Partners	252 551	0,12
USA			141 025 272	67,21
17 936	USD	Abbott Laboratories	2 044 883	0,97
4 875	USD	Adobe	2 524 178	1,20
83 981	USD	Alcon	8 403 980	4,01
1 528	USD	Alphabet	253 419	0,12
40 301	USD	Amazon.com	7 509 285	3,58
1 631	USD	American Express	442 327	0,21
2 137	USD	American Tower	496 981	0,24
1 633	USD	Apple	380 489	0,18
10 277	USD	Bank of America	407 791	0,19
11 894	USD	Becton Dickinson	2 867 643	1,37
50 867	USD	Boston Scientific	4 262 655	2,03
14 464	USD	Broadcom	2 495 040	1,19
127 056	USD	Carlyle Group	5 471 031	2,61
9 015	USD	Clean Harbors	2 179 016	1,04
22 840	USD	Clear Secure	756 918	0,36
11 508	USD	CONMED	827 655	0,39
2 564	USD	Constellation Brands	660 717	0,31
19 330	USD	DocuSign	1 200 200	0,57
653	USD	DR Horton	124 573	0,06
34 870	USD	Dun & Bradstreet Holdings	401 354	0,19
7 422	USD	Eaton	2 459 948	1,17
4 254	USD	Eli Lilly	3 768 789	1,80
25 333	USD	Extreme Networks	380 755	0,18
56 592	USD	GE Vernova	14 429 829	6,88
23 294	USD	General Electric	4 392 783	2,09
36 601	USD	Global Payments	3 748 674	1,79
103 105	USD	Globus Medical	7 376 132	3,52
3 386	USD	HCA Healthcare	1 376 172	0,66
21 723	USD	HEICO	4 426 278	2,11
23 307	USD	Ingersoll Rand	2 287 815	1,09
185	USD	KLA	143 266	0,07
5 519	USD	Lantheus Holdings	605 710	0,29
844	USD	Marriott International	209 818	0,10
26 637	USD	Medtronic	2 398 129	1,14
3 884	USD	Meta Platforms	2 223 357	1,06

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
10 248	USD	Microsoft	4 409 714	2,10
357	USD	Monolithic Power Systems	330 047	0,16
3 872	USD	Natera	491 550	0,23
38 448	USD	NVIDIA	4 669 125	2,23
15 726	USD	Old Dominion Freight Line	3 123 813	1,49
21 727	USD	PACCAR	2 144 020	1,02
48 279	USD	PagerDuty	895 575	0,43
159 930	USD	Portillo's	2 154 257	1,03
1 762	USD	Procter & Gamble	305 178	0,15
138 102	USD	Riskified	653 222	0,31
10 826	USD	Roper Technologies	6 024 019	2,87
1 345	USD	Ross Stores	202 436	0,10
13 854	USD	Royal Caribbean Cruises	2 457 145	1,17
770	USD	S&P Global	397 797	0,19
880	USD	Sherwin-Williams	335 870	0,16
1 003	USD	Skechers USA	67 121	0,03
1 526	USD	Smartsheet	84 479	0,04
23 811	USD	Tenable Holdings	964 822	0,46
12 261	USD	Tenet Healthcare	2 037 778	0,97
47 552	USD	Uber Technologies	3 574 008	1,70
6 052	USD	Union Pacific	1 491 697	0,71
4 465	USD	US Foods Holding	274 598	0,13
32 248	USD	Vistra	3 822 678	1,82
2 607	USD	Walmart	210 515	0,10
10 958	USD	Waste Connections	1 959 510	0,93
54 677	USD	Wells Fargo	3 088 704	1,47
3 756	USD	Workday	918 004	0,44
Summe Aktien			151 714 174	72,30
Anleihen				
USA			7 028 845	3,35
1 794 000	USD	United States Treasury Note 31/07/26, 4.38%	1 815 654	0,87
1 680 000	USD	United States Treasury Note 15/08/34, 3.88%	1 690 106	0,81
3 252 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/54, 4.63%	3 523 085	1,67
Summe Anleihen			7 028 845	3,35
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			158 743 019	75,65

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA			24 504 167	11,68
25 000 000	USD	United States Treasury Bill 20/03/25, ZCP	24 504 167	11,68
Summe Anleihen			24 504 167	11,68
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			24 504 167	11,68
Summe Kapitalanlagen			183 247 186	87,33
Sonstiges Nettovermögen			26 586 980	12,67
Nettoinventarwert			209 834 166	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Anleihen				
Deutschland			71 739	0,02
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	13 681	0,01
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	14 521	0,01
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	12 418	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	11 190	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	11 195	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	8 734	-
USA			47 438	0,01
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	7 637	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	8 307	0,01
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	8 121	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	8 288	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	7 554	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	7 531	-
Summe Anleihen			119 177	0,03
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			119 177	0,03

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Luxemburg			5 000 000	1,38
5 000 000	USD	JPMorgan Liquidity Funds - US Dollar Treasury CNAV Fund	5 000 000	1,38
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			5 000 000	1,38
Summe Kapitalanlagen			5 119 177	1,41
Termineinlagen				
Finanzen			234 000 000	64,42
54 000 000	USD	Banque NA 01/10/24, 4.80%	54 000 000	14,86
54 000 000	USD	Credit Agricole 01/10/24, 4.81%	54 000 000	14,86
54 000 000	USD	JPMorgan Chase Bank 01/10/24, 5.30%	54 000 000	14,87
18 000 000	USD	Mizuho Bank 01/10/24, 4.82%	18 000 000	4,96
54 000 000	USD	Toronto-Dominion Bank 01/10/24, 4.80%	54 000 000	14,87
Summe Termineinlagen			234 000 000	64,42
Sonstiges Nettovermögen			124 121 602	34,17
Nettoinventarwert			363 240 779	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
Aktien				
Australien			1 176 941	0,39
98 982	GBP	Glencore	565 992	0,19
3 803	AUD	Macquarie Group	610 949	0,20
Österreich			1 275 446	0,43
10 752	EUR	Addiko Bank	209 450	0,07
10 050	EUR	BAWAG Group	778 068	0,26
5 252	EUR	Erste Group Bank	287 928	0,10
Belgien			1 154 090	0,39
12 905	EUR	Ageas	688 380	0,23
7 764	EUR	Azelis Group	170 171	0,06
1 590	EUR	KBC Group	126 407	0,04
1 895	EUR	Kinopolis Group	84 377	0,03
470	EUR	UCB	84 755	0,03
Bermuda			276 891	0,09
14 317	USD	Hamilton Insurance Group	276 891	0,09
Brasilien			747 619	0,25
95 815	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	70 353	0,02
238	USD	MercadoLibre	488 366	0,17
10 935	USD	NU Holdings	149 263	0,05
649	CAD	Wheaton Precious Metals	39 637	0,01
Kanada			4 900 558	1,64
141 087	CAD	Advantage Energy	985 820	0,33
71 371	CAD	ARC Resources	1 206 359	0,40
11 468	USD	Canadian Natural Resources	380 852	0,13
12 497	CAD	Headwater Exploration	58 491	0,02
60 998	CAD	Kelt Exploration	282 338	0,09
12 133	CAD	MEG Energy	227 956	0,08
64 879	CAD	NuVista Energy	533 443	0,18
87 516	CAD	Peyto Exploration & Development	996 522	0,33
1 615	USD	Teck Resources	84 368	0,03
3 668	USD	Xenon Pharmaceuticals	144 409	0,05
Chile			97 051	0,03
9 263	CAD	Lundin Mining	97 051	0,03
China			447 166	0,15
1 303	USD	Baidu	137 193	0,05
14 465	HKD	ENN Energy Holdings	111 737	0,04
58 200	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	42 075	0,01
6 469	USD	Zai Lab	156 161	0,05

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Zypern			48 762	0,02
9 726	GBP	Bank of Cyprus Holdings	48 762	0,02
Tschechische Republik			117 570	0,04
3 337	CZK	Komerční Banka	117 570	0,04
Dänemark			527 127	0,18
559	DKK	Genmab	135 231	0,05
1 923	DKK	Novo Nordisk	225 940	0,07
2 490	DKK	NTG Nordic Transport Group	107 088	0,04
291	DKK	Pandora	47 909	0,02
57	DKK	Royal Unibrew	4 788	-
402	DKK	Scandinavian Tobacco Group	6 171	-
Finnland			1 775 163	0,59
46 414	SEK	Nordea Bank Abp	546 593	0,18
26 341	EUR	Sampo	1 228 570	0,41
Frankreich			1 722 424	0,58
728	EUR	Accor	31 605	0,01
1 820	EUR	BNP Paribas	124 696	0,04
1 150	EUR	Dassault Aviation	236 823	0,08
7 406	EUR	Exclusive Networks	194 970	0,07
40	EUR	Hermes International	98 224	0,03
2 750	EUR	IPSOS	172 803	0,06
1 258	EUR	Legrand	144 655	0,05
764	EUR	Publicis Groupe	83 514	0,03
9 797	EUR	Société Générale	243 738	0,08
23	EUR	Thales	3 650	-
3 091	EUR	TotalEnergies	201 284	0,07
16 585	EUR	Ubisoft Entertainment	186 462	0,06
Deutschland			5 633 560	1,89
3 303	EUR	Allianz	1 084 637	0,35
514	EUR	Beiersdorf	77 327	0,03
20 981	EUR	Commerzbank	385 941	0,13
23 374	EUR	Deutsche Bank	403 239	0,14
2 022	EUR	Formycon	122 668	0,04
87	EUR	FUCHS	4 220	-
726	EUR	Heidelberg Materials	78 875	0,03
1 111	EUR	Hensoldt	36 433	0,01
435	EUR	HUGO BOSS	19 897	0,01
18 256	USD	Immatics	208 301	0,07
6 672	EUR	IONOS Group	166 363	0,06
6 347	EUR	Jenoptik	194 999	0,07
386	EUR	RENK Group	9 539	-

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermög- en
968	EUR	Rheinmetall	524 110	0,18
14 789	EUR	RWE	537 990	0,18
3 091	EUR	Siemens	623 945	0,21
179 142	GBP	Sirius Real Estate	233 756	0,08
10 948	EUR	Talanx	921 320	0,30
Hongkong			770 506	0,26
10 000	HKD	AIA Group	89 595	0,03
73 323	GBP	Prudential	680 911	0,23
Ungarn			241 226	0,08
4 614	HUF	OTP Bank	241 226	0,08
Irland			64 477	0,02
3 854	USD	Prothena	64 477	0,02
Italien			2 612 323	0,87
53 949	EUR	Banca Monte dei Paschi di Siena	311 196	0,10
26 300	EUR	BFF Bank	288 221	0,10
93	EUR	Buzzi	3 706	-
2 682	EUR	DiaSorin	313 176	0,10
24 521	EUR	FinecoBank Banca Fineco	419 669	0,14
57 441	EUR	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ	161 130	0,05
1 787	USD	Stevanato Group	35 740	0,01
24 635	EUR	UniCredit	1 079 485	0,37
Japan			3 755 342	1,26
3 546	JPY	Bank of Nagoya	152 967	0,05
32 517	JPY	Chiba Bank	260 747	0,09
6 377	JPY	Chugai Pharmaceutical	307 569	0,10
61 051	JPY	Concordia Financial Group	336 423	0,11
2 014	JPY	Daiichi Sankyo	65 987	0,02
406	JPY	Hokuhoku Financial Group	4 414	-
7 990	JPY	Kyoto Financial Group	122 553	0,04
57 981	JPY	Mebuki Financial Group	231 763	0,08
31 339	JPY	Mizuho Financial Group	640 190	0,22
4 805	JPY	Otsuka Holdings	270 230	0,09
20 861	JPY	Rakuten Bank	468 093	0,16
23 121	JPY	Shiga Bank	522 022	0,18
12 325	JPY	Sony Group	238 182	0,08
73 339	JPY	Tochigi Bank	134 202	0,04
Jersey			1 400 788	0,47
29 177	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1 400 788	0,47
Luxemburg			257 166	0,09
11 511	EUR	CVC Capital Partners	257 166	0,09

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
Mexiko			64 545	0,02
7 895	GBP	Fresnillo	64 545	0,02
Niederlande			874 107	0,29
1 091	USD	Argenx	591 410	0,19
102	EUR	ASML Holding	84 656	0,03
3 964	USD	Merus	198 041	0,07
Norwegen			896 760	0,30
17 627	NOK	DNB Bank	361 460	0,12
8 459	USD	Seadrill	336 161	0,11
18 132	NOK	Storebrand	199 139	0,07
Polen			117 120	0,04
4 864	PLN	Alior Bank	117 120	0,04
Singapur			9 552	-
3 789	SGD	Singapore Telecommunications	9 552	-
Südafrika			574 279	0,19
17 684	GBP	Anglo American	574 279	0,19
Spanien			1 256 129	0,42
111 375	EUR	Banco de Sabadell	236 672	0,08
537 826	EUR	Linea Directa Aseguradora Cia de Seguros y Reaseguros	646 576	0,22
14 608	EUR	Merlin Properties Socimi	184 886	0,06
147 498	EUR	Unicaja Banco	187 995	0,06
Schweden			1 383 025	0,46
23 032	SEK	Atlas Copco	445 520	0,16
8 868	SEK	Cibus Nordic Real Estate publ	153 769	0,05
4 662	SEK	Haypp Group	37 642	0,01
17 651	USD	SiriusPoint	253 115	0,08
11 049	SEK	SKF	219 765	0,07
26 616	SEK	Svenska Handelsbanken	273 214	0,09
Schweiz			2 721 851	0,91
1 365	CHF	Baloise Holding	278 209	0,09
3 102	CHF	Cie Financiere Richemont	490 397	0,16
3 120	CHF	Galderma Group	289 752	0,10
1 970	CHF	Novartis	226 130	0,08
11 691	USD	On Holding	586 305	0,19
1 432	CHF	Sulzer	234 169	0,08
139	CHF	Swiss Life Holding	115 950	0,04
16 269	CHF	UBS Group	500 939	0,17
Taiwan			73 115	0,02
421	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	73 115	0,02
Thailand			145 625	0,05
7 962	USD	BKV	145 625	0,05

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Vereinigtes Königreich			5 695 656	1,91	959	USD	BILL Holdings	50 597	0,02
5 266	GBP	AstraZeneca	815 839	0,27	840	USD	Biogen	162 826	0,05
17 418	USD	Autolus Therapeutics	63 227	0,02	2 454	USD	Blueprint Medicines	226 995	0,08
569 288	GBP	Barclays	1 709 072	0,58	78	USD	Booking Holdings	328 545	0,11
67 855	GBP	Beazley	690 370	0,23	1 941	USD	Boston Scientific	162 656	0,05
42 575	GBP	Deliveroo	87 942	0,03	16 581	GBP	BP	86 832	0,03
108	GBP	Genus	2 895	-	3 387	USD	Broadcom	584 258	0,20
581	GBP	Hill & Smith	15 924	0,01	137	USD	Burlington Stores	36 097	0,01
825	USD	Immunocore Holdings	25 682	0,01	275	USD	Cadence Design Systems	74 533	0,02
5 060	GBP	National Grid	69 679	0,02	1 604	USD	Caesars Entertainment	66 951	0,02
284 631	GBP	NewRiver Real Estate Investment Trust	307 855	0,10	3 376	USD	Capital One Financial	505 488	0,17
11 125	GBP	Savills	176 401	0,06	6 415	USD	Cargo Therapeutics	118 357	0,04
2 818	GBP	Serco Group	6 706	-	264	USD	Celldex Therapeutics	8 973	-
5 290	GBP	Softcat	109 765	0,04	325	USD	Cencora	73 151	0,02
46 781	GBP	Standard Chartered	495 973	0,17	3 475	USD	Centene	261 598	0,09
15 121	NOK	Subsea 7	244 304	0,08	2 070	USD	CG oncology	78 101	0,03
7 258	GBP	Unilever	469 556	0,16	1 098	USD	Cheniere Energy	197 464	0,07
29 634	GBP	UNITE Group	372 420	0,12	15 027	USD	Chesapeake Energy	1 235 971	0,41
1 644	GBP	WH Smith	32 046	0,01	8 100	USD	Chord Energy	1 054 863	0,35
USA			56 568 336	18,94	31 732	USD	Citizens Financial Group	1 303 232	0,44
2 006	USD	Abbott Laboratories	228 704	0,08	5 554	USD	ConocoPhillips	584 725	0,20
4 509	USD	Acadia Healthcare	285 916	0,10	7 946	USD	Coterra Energy	190 307	0,06
930	USD	Addus HomeCare	123 718	0,04	15 102	USD	Crescent Energy	165 367	0,06
20 772	USD	agilon health	81 634	0,03	4 783	USD	Crinetics Pharmaceuticals	244 411	0,08
7 308	USD	Akero Therapeutics	209 667	0,07	200	USD	Crown Castle	23 726	0,01
1 056	USD	Align Technology	268 562	0,09	5 680	USD	Cytokinetics	299 904	0,10
12 199	USD	Alignment Healthcare	144 192	0,05	708	USD	Danaher	196 838	0,07
9 884	USD	Alkermes	276 653	0,09	535	USD	Datadog	61 557	0,02
2 507	USD	Alnylam Pharmaceuticals	689 500	0,23	4 466	USD	Denali Therapeutics	130 095	0,04
4 372	USD	Alphabet	730 955	0,24	4 689	USD	Diamondback Energy	808 384	0,27
4 370	USD	Amazon.com	814 262	0,27	3 787	USD	Disc Medicine	186 093	0,06
5 277	USD	American Express	1 431 121	0,49	1 590	USD	Discover Financial Services	223 061	0,07
309	USD	American Tower	71 861	0,02	3 002	USD	Dominion Energy	173 486	0,06
60 883	USD	Antero Resources	1 744 297	0,59	644	USD	DoorDash	91 918	0,03
4 888	USD	APA	119 560	0,04	5 215	USD	DraftKings	204 428	0,07
8 083	USD	Apellis Pharmaceuticals	233 114	0,08	1 599	USD	DT Midstream	125 777	0,04
2 108	USD	Apogee Therapeutics	123 824	0,04	4 152	USD	Dutch Bros	132 989	0,04
2 360	USD	Apple	549 880	0,18	4 144	USD	Edison International	360 901	0,12
2 800	USD	Ardent Health Partners	51 464	0,02	3 684	USD	Edwards Lifesciences	243 107	0,08
12 052	USD	Ares Management	1 878 183	0,64	1 869	USD	Elanco Animal Health	27 456	0,01
6 322	USD	Argan	641 240	0,21	179	USD	Elastic	13 740	-
907	USD	Arista Networks	348 125	0,12	650	USD	Electronic Arts	93 236	0,03
1 653	USD	ARM Holdings	236 396	0,08	227	USD	Elevance Health	118 040	0,04
4 982	USD	Atmos Energy	691 053	0,23	124	USD	Encompass Health	11 983	-
4 279	USD	AtriCure	119 983	0,04	2 439	USD	Enphase Energy	275 656	0,09
4 531	USD	AZEK	212 051	0,07	2 515	USD	EOG Resources	309 169	0,10
1 306	USD	Bicara Therapeutics	33 264	0,01					

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
41 077	USD	EQT	1 505 060	0,51	24 459	USD	Nasdaq	1 785 751	0,61
2 365	USD	EverQuote	49 878	0,02	535	USD	Natera	67 918	0,02
3 495	USD	Evolent Health	98 839	0,03	13 439	USD	Navigator Holdings	215 965	0,07
9 781	USD	Exact Sciences	666 282	0,22	1 859	CHF	Nestle	186 614	0,06
2 551	USD	Exelon	103 443	0,03	15 153	USD	Net Power	106 223	0,04
206	USD	Expedia Group	30 492	0,01	4 940	USD	News	131 552	0,04
5 337	USD	Exxon Mobil	625 603	0,21	4 124	USD	NextDecade	19 424	0,01
664	USD	First Solar	165 628	0,06	1 000	USD	NEXTracker	37 480	0,01
486	USD	Five Below	42 938	0,01	3 984	USD	NiSource	138 046	0,05
19 279	USD	Flex	644 497	0,22	2 810	USD	Nurix Therapeutics	63 141	0,02
1 306	USD	Fluor	62 309	0,02	2 089	USD	Nuvalent	213 705	0,07
2 795	USD	Freshpet	382 272	0,13	3 625	USD	NVIDIA	440 220	0,15
501	USD	Global Payments	51 312	0,02	273	USD	Okta	20 295	0,01
7 467	USD	Golden Entertainment	237 376	0,08	4 795	USD	ONE Gas	356 844	0,12
6 149	GBP	GSK	124 670	0,04	1 352	USD	ONEOK	123 208	0,04
4 915	USD	Guardant Health	112 750	0,04	6 703	USD	PACS Group	267 919	0,09
670	USD	Gulfport Energy	101 405	0,03	4 843	USD	PG&E	95 746	0,03
19 502	USD	HA Sustainable Infrastructure Capital	672 234	0,23	710	USD	Phillips 66	93 330	0,03
957	USD	HCA Healthcare	388 954	0,13	2 783	USD	Pinterest	90 086	0,03
1 248	USD	Hilton Worldwide Holdings	287 664	0,10	2 027	USD	Privia Health Group	36 912	0,01
581	USD	HubSpot	308 860	0,10	600	USD	PTC Therapeutics	22 260	0,01
692	USD	Humana	219 184	0,07	8 014	USD	QIAGEN	365 198	0,12
430	USD	Hyatt Hotels	65 446	0,02	972	USD	Red Rock Resorts	52 916	0,02
303	USD	ICON	87 055	0,03	1 349	USD	REVOLUTION Medicines	61 177	0,02
313	USD	Intuitive Surgical	153 768	0,05	94	USD	RH	31 436	0,01
6 344	USD	Ionis Pharmaceuticals	254 141	0,09	9 506	USD	Rocket Pharmaceuticals	175 576	0,06
3 072	USD	JPMorgan Chase	647 762	0,22	1 288	USD	S&P Global	665 407	0,22
20 163	USD	KKR	2 632 884	0,89	1 081	USD	Salesforce	295 881	0,10
15 438	USD	Kodiak Gas Services	447 702	0,15	550	USD	Sarepta Therapeutics	68 690	0,02
1 676	USD	Kymera Therapeutics	79 325	0,03	249	USD	SBA Communications	59 934	0,02
1 254	USD	Legend Biotech	61 107	0,02	1 393	USD	Schlumberger	58 436	0,02
1 228	USD	Liberty Media-Liberty Formula One	95 084	0,03	2 879	USD	SEACOR Marine Holdings	27 782	0,01
5 520	USD	Live Nation Entertainment	604 385	0,20	6 838	USD	Sempra	571 862	0,19
4 142	USD	Longboard Pharmaceuticals	138 053	0,05	7 992	GBP	Shell	259 109	0,09
94	USD	Madison Square Garden Sports	19 576	0,01	24 723	USD	Southwestern Energy	175 781	0,06
3 669	USD	Maplebear	149 475	0,05	548	USD	Spotify Technology	201 954	0,07
3 697	USD	Marathon Petroleum	602 278	0,20	5 837	USD	State Street	516 399	0,17
19 318	USD	Matador Resources	954 696	0,32	9 588	USD	Stifel Financial	900 313	0,30
496	USD	McDonald's	151 037	0,05	10 456	USD	Structure Therapeutics	458 914	0,15
4 828	USD	Merck	548 268	0,18	12 730	USD	Sunrun	229 904	0,08
3 306	USD	Micron Technology	342 865	0,11	5 603	USD	Surgery Partners	180 641	0,06
206	USD	Molina Healthcare	70 979	0,02	2 272	USD	Syndax Pharmaceuticals	43 736	0,01
1 920	USD	Murphy Oil	64 781	0,02	250	USD	Take-Two Interactive Software	38 428	0,01

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 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- vermö- gen
2 934	USD	Targa Resources	434 261	0,15
137	USD	Thermo Fisher Scientific	84 744	0,03
4 109	USD	Tidewater	294 985	0,10
11 164	USD	TPG	642 600	0,22
1 026	USD	Tradeweb Markets	126 885	0,04
1 950	USD	TransUnion	204 165	0,07
1 859	USD	Uber Technologies	139 722	0,05
1 434	USD	United Therapeutics	513 874	0,17
1 419	USD	UnitedHealth Group	829 661	0,28
3 335	USD	Valero Energy	450 325	0,15
530	USD	Vaxcyte	60 563	0,02
219	USD	Vertex Pharmaceuticals	101 853	0,03
600	USD	Vertiv Holdings	59 694	0,02
29 336	USD	Viper Energy	1 323 346	0,44
666	USD	Walt Disney	64 063	0,02
4 931	USD	WEC Energy Group	474 264	0,16
8 634	USD	Wells Fargo	487 735	0,16
19 177	USD	Williams	875 430	0,29
343	USD	Wingstop	142 715	0,05
Summe Aktien			99 382 296	33,27
Anleihen				
Kanada			85 350	0,03
115 000	CAD	Advantage Energy 30/06/29, 5.00%	85 350	0,03
Japan			373 266	0,12
52 400 000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond 20/06/54, 2.20%	373 266	0,12
Mexiko			2 390 681	0,79
561 563 800	MXN	Mexico Cetes 06/08/26, ZCP	2 390 681	0,79
Neuseeland			226 797	0,08
363 000	NZD	New Zealand Government Bond 15/05/36, 4.25%	226 797	0,08
Peru			1 181 684	0,40
2 845 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/31, 6.95%	821 726	0,28
1 314 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6.15%	359 958	0,12
Südafrika			791 651	0,27
15 744 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	791 651	0,27

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Supranational			476 412	0,16
32 000 000	ZAR	European Bank for Reconstruction & Development 30/05/36, ZCP	476 412	0,16
Summe Anleihen			5 525 841	1,85
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			104 908 137	35,12

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Belgien			725 973	0,24
570 000	EUR	Kingdom of Belgium Treasury Bill 07/11/24, ZCP	632 198	0,21
85 000	EUR	Kingdom of Belgium Treasury Bill 09/01/25, ZCP	93 775	0,03
Kanada			10 229 613	3,42
13 850 000	CAD	Canadian Treasury Bill 10/10/24, ZCP	10 229 613	3,42
Frankreich			3 279 913	1,10
480 000	EUR	France Treasury Bill BTF 09/10/24, ZCP	533 881	0,18
805 000	EUR	France Treasury Bill BTF 18/12/24, ZCP	889 201	0,30
875 000	EUR	France Treasury Bill BTF 12/02/25, ZCP	962 307	0,32
815 000	EUR	France Treasury Bill BTF 12/03/25, ZCP	894 524	0,30
Deutschland			4 164 850	1,39
3 110 000	EUR	German Treasury Bill 20/11/24, ZCP	3 445 830	1,15
650 000	EUR	German Treasury Bill 11/12/24, ZCP	719 020	0,24
Vereinigtes Königreich			271 428	0,09
280 000	USD	Connect Finco Sarl 15/09/29, 9.00%	271 428	0,09
USA			142 944 239	47,87
400 000	USD	Aethon United BR 01/10/29, 7.50%	405 798	0,14
47 000	USD	Enphase Energy 01/03/28, ZCP	41 501	0,01
755 000	USD	Liberty Mutual Group 15/12/51, variabel	714 343	0,24
56 000	USD	Sunnova Energy 01/09/26, 5.88%	52 334	0,02

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
71 000	USD	Sunnova Energy International 15/02/28, 2.63%	46 633	0,02
88 000	USD	Sunrun 01/02/26, ZCP	81 205	0,03
58 000	USD	Sunrun 01/03/30, 4.00%	78 097	0,03
400 000	USD	Tidewater 03/07/28, 10.38%	432 000	0,14
1 490 000	USD	United States Treasury Bill 01/10/24, ZCP	1 490 000	0,50
580 000	USD	United States Treasury Bill 03/10/24, ZCP	579 833	0,19
12 925 000	USD	United States Treasury Bill 08/10/24, ZCP	12 911 992	4,32
21 430 000	USD	United States Treasury Bill 15/10/24, ZCP	21 387 048	7,16
20 430 000	USD	United States Treasury Bill 22/10/24, ZCP	20 368 939	6,82
9 745 000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP	9 713 126	3,25
6 435 000	USD	United States Treasury Bill 29/10/24, ZCP	6 409 567	2,15
4 185 000	USD	United States Treasury Bill 31/10/24, ZCP	4 168 553	1,40
7 760 000	USD	United States Treasury Bill 05/11/24, ZCP	7 722 728	2,59
1 365 000	USD	United States Treasury Bill 07/11/24, ZCP	1 357 891	0,45
1 600 000	USD	United States Treasury Bill 12/11/24, ZCP	1 590 966	0,53
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 14/11/24, ZCP	9 938 035	3,33
10 815 000	USD	United States Treasury Bill 19/11/24, ZCP	10 747 035	3,60
7 100 000	USD	United States Treasury Bill 29/11/24, ZCP	7 046 162	2,36
8 175 000	USD	United States Treasury Bill 05/12/24, ZCP	8 103 703	2,71
1 365 000	USD	United States Treasury Bill 10/12/24, ZCP	1 352 429	0,45
5 505 000	USD	United States Treasury Bill 12/12/24, ZCP	5 452 087	1,83
2 375 000	USD	United States Treasury Bill 19/12/24, ZCP	2 351 247	0,79
3 645 000	USD	United States Treasury Bill 30/01/25, ZCP	3 587 572	1,20
2 115 000	USD	United States Treasury Bill 06/02/25, ZCP	2 078 791	0,70
1 670 000	USD	United States Treasury Bill 20/02/25, ZCP	1 639 053	0,55
940 000	USD	Welltower OP 15/07/29, 3.13%	1 095 571	0,36
Summe Anleihen			161 616 016	54,11
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			161 616 016	54,11

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Kanada				
3 200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-
Summe Aktien			-	-
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 übertragbare Wertpapiere			-	-
Summe Kapitalanlagen			266 524 153	89,23
Sonstiges Nettovermögen			32 159 730	10,77
Nettoinventarwert			298 683 883	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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 Teilfonds in übertragbaren Wertpapieren und anderen zulässigen Vermögenswerten jeder Art, einschliesslich derivativer Finanzinstrumente, anzulegen, um das Anlagerisiko zu streuen und die Erträge aus ihrem Portfoliomanagement an ihre Anteilsinhaber weiterzugeben.

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

Anteilsklassen

Die für die einzelnen Teilfonds verfügbaren Anteilsklassen sind im aktuellen Prospekt aufgeführt, zusammen mit Einzelheiten zu etwaigen Mindestzeichnungen, Mindestfolgezeichnungen und Mindestbeteiligungen sowie (gegebenenfalls) Einzelheiten zu den Ausgabeaufschlägen für jede Anteilsklasse.

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

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 Geschäftsjahres berechneten NIW (30. September 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.

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 Gesamtabschluss 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 Jahresende geltenden Wechselkurse verwendet.

Swing-Pricing

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

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. Diese Anpassung kann von Teilfonds zu Teilfonds variieren und wird voraussichtlich unter normalen Marktbedingungen an einem Handelstag höchstens 2% des nicht angepassten Nettoinventarwerts je Anteil des betreffenden Fonds betragen.

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

Am 30. September 2024, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahres, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für den Schroder GAIA Egerton Equity vorgenommen. In der folgenden Tabelle sind die offiziellen Nettoinventarwerte je Anteil dieses Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin aufgeführt. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

	Währung	Schroder GAIA Egerton Equity
Nettoinventarwert je Anteil* (einschliesslich Swing-Pricing-Anpassung)		
zum 30. September 2024		
Klasse A Thes.	EUR	266,67
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	GBP	258,66
Klasse A Thes., in USD abgesichert	USD	280,10
Klasse A Aussch. GBP	GBP	246,64
Klasse A1 Thes.	EUR	247,06
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	USD	266,55
Klasse C Thes.	EUR	292,51
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	281,34
Klasse C Thes., in USD abgesichert	USD	307,47
Klasse C Aussch.	EUR	290,98
Klasse C Aussch. GBP	GBP	270,85
Klasse E Thes.	EUR	290,40
Klasse X Thes.	EUR	289,70

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

Fair Value Pricing

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

Zum 30. September 2024 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiernamen
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
Schroder GAIA Helix	CFD auf TRINITY LIMITED
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals
	Credit Suisse Group perpetual, 7,25%
	Credit Suisse Group perpetual, 7,50%
	Credit Suisse Group perpetual, 7,50%

Besteuerung

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

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

Auf Anteilklassen 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. Für die Anteilklassen I sind keine Managementgebühren aus dem Nettovermögen zu entrichten, den Anlegern werden jedoch direkt von Schroders Gebühren in Rechnung gestellt. Die für das Berichtsjahr tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Managementgebühren (Forts.)

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schröder GAIA Asian Equity Long Short	A-Anteile	2,00%
	C- und IZ-Anteile*	1,00%
	E-Anteile	0,75%
	X1-Anteile	0,85%
	I-Anteile	0,00%
Schröder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60%
	C-, E- und N-Anteile	1,00%
Schröder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50%
	C- und IF-Anteile	1,10%
	PI-Anteile	0,46%
	X-Anteile	0,75%
	Y-Anteile	0,88%
	Y1-Anteile	1,28%
	Y2-Anteile	0,24%
	I-Anteile	0,00%
Schröder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00%
	C-Anteile	1,25%
	E-Anteile	1,00%
Schröder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00%
	C-, E- und X-Anteile	1,25%
Schröder GAIA Helix	A-Anteile	2,00%
	C-, C1- und IZ-Anteile	1,00%
	E-Anteile	0,75%
	S-Anteile	0,35%
	X-Anteile	0,60%
	I-Anteile	0,00%
Schröder GAIA Oaktree Credit	A2-Anteile	1,25%
	C-Anteile	0,75%
	E-Anteile	0,60%
	I-Anteile	0,00%
Schröder 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%
Schröder GAIA Sirios US Equity	A-Anteile	2,00%
	C- und X-Anteile	1,25%
	E-Anteile	1,00%
Schröder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40%
	K-Anteile	1,90%
Schröder GAIA Wellington Pagosa	A-Anteile	2,00%
	C- und C1-Anteile	1,25%
	E-Anteile	0,75%

* Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen C und IZ des Schröder GAIA Asian Equity Long Short wurde mit Wirkung zum 1. Januar 2024 von 1,25% auf 1,00% gesenkt.

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

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 Wertentwicklungsjahres die High-Water-Mark übersteigt. Als Referenz gilt der jemals am Ende eines vorhergehenden Wertentwicklungsjahres verzeichnete Nettoinventarwert pro Anteil (die „High-Water-Mark“).

Die Performancegebühr einer Anteilsklasse läuft an jedem Geschäftstag auf und wird am nächstfolgenden Berechnungstag in den Nettoinventarwerten der Teilfonds berücksichtigt, und zwar auf Grundlage der Differenz zwischen dem Nettoinventarwert je Anteil am gleichen Berechnungstag (vor Abzug etwaiger Rückstellungen für die Performancegebühr) und der Hurdle, multipliziert mit der durchschnittlichen Zahl der während des Geschäftsjahres ausgegebenen Anteile oder im Falle einer auf der Outperformance gegenüber der Benchmark basierenden Performancegebühr mit dem angestrebten

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Performancegebühren (Forts.)

Nettoinventarwert je Anteil (d. h. dem hypothetischen Nettoinventarwert je Anteil, der unter Zugrundelegung der Wertentwicklung der Benchmark bis zum Geschäftstag erzielt worden wäre) oder, sofern höher, anhand der High-Water-Mark multipliziert mit der durchschnittlichen Anzahl der während des Geschäftsjahres umlaufenden Anteile. Für I-Anteile wird keine Performancegebühr berechnet.

Die Teilfonds, für die Performancegebühren während des Berichtsjahres berechnet wurden, sowie die Daten der jeweiligen Anlageverwalter und die Benchmarks sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt: Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für das Jahr zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Fällige Performancegebühren“ ausgewiesen. Die für die einzelnen Anteilklassen während des Berichtsjahres in Rechnung gestellten Performancegebühren sind auf den Seiten 147-148 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	
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 BRL abgesichert	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 BRL abgesichert	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)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Performancegebühren (Forts.)

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).

Vertriebsgebühren

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 werden keine weiteren Vertriebsgebühren erhoben.

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.

Betriebskosten

Der Teilfonds zahlt andere im Zuge des Betriebs der Gesellschaft anfallende Betriebskosten. Hierbei handelt es sich um gesetzliche Gebühren, und zwar überwiegend Prüfungs-, Rechtsberatungs- und Veröffentlichungskosten. Nähere Anhaben hierzu sind unter „Sonstige Aufwendungen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung ausgewiesen.

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 18 915 EUR. Bernard Herman erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 24 500 EUR. Eric Bertrand erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 26 500 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 22 000 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 18 636 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

Devisenterminkontrakte

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

Am 30. September 2024 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short					
Absicherung des Portfolios					
AUD	41 718 000	USD	28 334 496	17. Okt. 2024	514 569
GBP	4 100 000	USD	5 352 091	17. Okt. 2024	129 368
NZD	380 000	USD	231 247	17. Okt. 2024	10 174
SGD	12 094 000	USD	9 178 315	17. Okt. 2024	238 966
USD	958 949	AUD	1 471 000	17. Okt. 2024	(58 286)
USD	634 677	SGD	839 000	17. Okt. 2024	(18 630)
USD					816 161
Absicherung der Anteilsklasse					
GBP	31 232 186	USD	41 444 848	31. Okt. 2024	310 417
USD	1 030 355	GBP	773 921	31. Okt. 2024	(4 324)
USD					306 093
USD					1 122 254
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	56 266 034	USD	38 137 114	16. Okt. 2024	771 620
BRL	1 700 880	USD	306 881	25. Okt. 2024	4 455
BRL	155 274 400	USD	28 005 274	18. Dez. 2024	236 931
CAD	28 984 716	USD	21 470 875	16. Okt. 2024	(32 587)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
CHF	18 071 450	USD	21 446 032	16. Okt. 2024	(57 347)
CLP	17 720 412 296	USD	19 410 983	18. Dez. 2024	281 793
CNH	16 093 497	USD	2 301 455	08. Okt. 2024	(3 617)
CNH	4 395 467	USD	628 465	09. Okt. 2024	(834)
CNH	105 629 293	USD	14 949 117	16. Okt. 2024	143 940
CNH	14 640 447	USD	2 094 898	20. Nov. 2024	3 223
EUR	49 700 000	USD	55 200 097	16. Okt. 2024	157 074
EUR	3 545 000	USD	3 967 138	25. Okt. 2024	(16 921)
GBP	42 900 000	USD	56 400 622	16. Okt. 2024	954 154
HUF	17 180 773 400	USD	48 331 491	16. Okt. 2024	(222 053)
IDR	227 840 368 087	USD	14 706 019	18. Dez. 2024	296 113
ILS	26 697 184	USD	7 239 181	16. Okt. 2024	(75 665)
INR	3 074 661 571	USD	36 584 063	18. Dez. 2024	(35 588)
JPY	1 412 093 951	USD	9 858 628	16. Okt. 2024	(13 265)
KRW	10 536 549 099	USD	7 931 574	18. Dez. 2024	162 983
MXN	71 845 161	USD	3 708 614	16. Okt. 2024	(68 056)
NOK	245 242 172	USD	23 288 803	16. Okt. 2024	(45 975)
NZD	35 100 000	USD	21 804 108	16. Okt. 2024	495 484
PHP	758 701 549	USD	13 508 767	18. Dez. 2024	26 657
PLN	185 330 972	USD	48 028 245	16. Okt. 2024	107 465
SEK	200 006 968	USD	19 455 362	16. Okt. 2024	252 446
SGD	39 183 849	USD	30 120 338	16. Okt. 2024	389 308
THB	339 886 265	USD	10 111 634	16. Okt. 2024	461 868
TWD	428 302 599	USD	13 626 309	18. Dez. 2024	(925)
USD	6 898 270	AUD	10 066 034	16. Okt. 2024	(62 531)
USD	3 177 240	AUD	4 630 000	25. Okt. 2024	(24 973)
USD	300 000	BRL	1 700 880	25. Okt. 2024	(11 336)
USD	287 175	BRL	1 597 196	26. Nov. 2024	(4 127)
USD	24 786 673	BRL	140 461 280	18. Dez. 2024	(761 234)
USD	16 679 250	CAD	22 635 374	16. Okt. 2024	(62 801)
USD	1 771 208	CAD	2 390 000	25. Okt. 2024	3 055
USD	6 767 617	CHF	5 719 958	16. Okt. 2024	(2 309)
USD	118 268	CHF	100 000	25. Okt. 2024	(225)
USD	7 962 947	CLP	7 553 593 046	18. Dez. 2024	(431 394)
USD	2 300 002	CNH	16 093 497	08. Okt. 2024	2 166
USD	628 155	CNH	4 395 467	09. Okt. 2024	523
USD	5 878 560	CNH	41 714 581	16. Okt. 2024	(81 910)
USD	2 772 707	CNH	19 328 197	20. Nov. 2024	2 783
USD	10 188	CZK	230 000	25. Okt. 2024	29
USD	24 680 428	EUR	22 200 000	16. Okt. 2024	(46 517)
USD	12 852 026	EUR	11 535 000	25. Okt. 2024	(1 501)
USD	21 723 379	GBP	16 300 000	16. Okt. 2024	(68 764)
USD	1 360 864	GBP	1 020 000	25. Okt. 2024	(2 809)
USD	815 664	HKD	6 345 000	25. Okt. 2024	(780)
USD	13 326 189	HUF	4 745 625 610	16. Okt. 2024	37 533
USD	5 988	HUF	2 125 000	25. Okt. 2024	40
USD	4 111 285	IDR	63 849 979 556	18. Dez. 2024	(92 910)
USD	13 433 219	ILS	50 228 238	16. Okt. 2024	(44 260)
USD	9 485 043	INR	798 473 100	18. Dez. 2024	(6 397)
USD	7 966 181	JPY	1 130 787 130	16. Okt. 2024	82 136
USD	1 434 156	JPY	205 475 000	25. Okt. 2024	(508)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	3 005 892	KRW	4 006 042 421	25. Okt. 2024	(62 093)
USD	6 787 568	KRW	8 966 749 537	18. Dez. 2024	(101 014)
USD	12 451 080	MXN	248 133 710	16. Okt. 2024	(122 422)
USD	1 802	MXN	35 000	25. Okt. 2024	31
USD	12 156 742	NOK	131 232 192	16. Okt. 2024	(280 792)
USD	16 292 167	NZD	26 000 000	16. Okt. 2024	(226 047)
USD	2 061 599	PHP	115 902 385	18. Dez. 2024	(6 126)
USD	7 855 997	PLN	30 035 696	16. Okt. 2024	54 874
USD	10 314 926	SEK	105 865 860	16. Okt. 2024	(116 630)
USD	187 478	SEK	1 900 000	25. Okt. 2024	169
USD	13 681 622	SGD	17 576 911	16. Okt. 2024	(4 259)
USD	151 648	SGD	195 000	25. Okt. 2024	(265)
USD	3 547 791	THB	117 296 467	16. Okt. 2024	(101 179)
USD	65 817	THB	2 199 323	25. Okt. 2024	(2 648)
USD	67 477	TRY	2 380 000	25. Okt. 2024	(365)
USD	21 089 329	TWD	666 536 660	18. Dez. 2024	(114 883)
USD	14 874 402	ZAR	255 414 924	16. Okt. 2024	109 446
USD	688 569	ZAR	11 955 000	25. Okt. 2024	(1 942)
ZAR	755 282 363	USD	42 250 230	16. Okt. 2024	1 410 921
ZAR	9 435 000	USD	545 981	25. Okt. 2024	(1 022)
					USD 3 027 414
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	139 208 158	USD	24 875 704	31. Okt. 2024	587 013
CHF	1 355 240	USD	1 599 588	31. Okt. 2024	7 528
EUR	75 150 546	USD	83 497 692	31. Okt. 2024	267 148
GBP	107 689 987	USD	142 922 595	31. Okt. 2024	1 051 438
SEK	35 850 236	USD	3 508 520	31. Okt. 2024	26 881
USD	1 044 173	BRL	5 774 339	31. Okt. 2024	(12 019)
USD	134 605	CHF	113 444	31. Okt. 2024	76
USD	773 924	EUR	694 388	31. Okt. 2024	(58)
USD	1 460 715	GBP	1 095 510	31. Okt. 2024	(3 903)
USD	59 716	SEK	607 890	31. Okt. 2024	(231)
					USD 1 923 873
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	99 646 650	EUR	90 000 000	14. Nov. 2024	(721 143)
USD	6 499 766	NZD	10 800 000	14. Nov. 2024	(362 203)
					USD (1 083 346)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	229 597 758	USD	270 963 091	31. Okt. 2024	1 306 050
EUR	1 182 593 111	USD	1 313 846 192	31. Okt. 2024	4 304 184
GBP	37 202 640	USD	49 367 014	31. Okt. 2024	370 333
JPY	1 457 881	USD	10 206	31. Okt. 2024	(17)
SEK	8 901 165 924	USD	870 958 336	31. Okt. 2024	6 837 514
SGD	714 083	USD	553 416	30. Okt. 2024	3 049
USD	3 225	CHF	2 703	31. Okt. 2024	20
USD	559 928	EUR	500 983	31. Okt. 2024	1 517
USD	3 239 506	GBP	2 429 898	31. Okt. 2024	(9 100)
USD	203 474	SEK	2 051 213	31. Okt. 2024	1 192
					USD 12 814 742
					USD 11 731 396

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	1 003 544	USD	674 390	08. Nov. 2024	19 801
CAD	1 956 244	USD	1 441 112	08. Nov. 2024	6 664
EUR	3 582 224	USD	3 987 193	08. Nov. 2024	6 839
GBP	1 680 631	USD	2 187 111	08. Nov. 2024	59 736
JPY	868 300 864	USD	6 044 464	08. Nov. 2024	29 823
NOK	31 746 726	USD	2 996 460	08. Nov. 2024	12 956
USD	725 962	AUD	1 085 925	08. Nov. 2024	(25 216)
USD	1 347 364	CAD	1 831 374	08. Nov. 2024	(7 998)
USD	3 850 735	EUR	3 490 761	08. Nov. 2024	(41 320)
USD	2 651 860	GBP	2 030 785	08. Nov. 2024	(63 108)
USD	4 909 160	JPY	705 602 564	08. Nov. 2024	(26 956)
USD	2 168 650	NOK	23 075 173	08. Nov. 2024	(18 752)
				USD	(47 531)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	127 501 298	USD	22 770 055	31. Okt. 2024	551 345
CHF	3 388 122	USD	3 998 485	31. Okt. 2024	19 330
EUR	41 245 067	USD	45 825 986	31. Okt. 2024	146 883
GBP	59 718 924	USD	79 248 332	31. Okt. 2024	591 721
SEK	82 472 443	USD	8 069 822	31. Okt. 2024	63 266
SGD	961 762	USD	745 370	30. Okt. 2024	4 104
USD	525 403	BRL	2 907 334	31. Okt. 2024	(6 380)
USD	3 921	EUR	3 505	31. Okt. 2024	14
USD	737 007	GBP	550 164	31. Okt. 2024	1 479
USD	26 952	SEK	272 663	31. Okt. 2024	62
				USD	1 371 824
				USD	1 324 293
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CNY	4 863 000	EUR	621 541	15. Okt. 2024	1 566
EUR	9 629 555	CAD	14 414 000	15. Okt. 2024	57 667
EUR	3 441 648	CHF	3 235 000	15. Okt. 2024	4 385
EUR	622 488	CNY	4 863 000	15. Okt. 2024	(619)
EUR	1 324 107	DKK	9 874 000	15. Okt. 2024	(698)
EUR	1 929 896	INR	179 654 000	15. Okt. 2024	6 236
EUR	2 951 898	JPY	474 164 000	15. Okt. 2024	(15 878)
EUR	13 877 211	MXN	306 619 000	15. Okt. 2024	(75 059)
EUR	837 594	SEK	9 518 000	15. Okt. 2024	(4 419)
EUR	366 451 821	USD	405 774 000	15. Okt. 2024	2 128 031
GBP	13 252 000	EUR	15 730 366	15. Okt. 2024	176 965
KRW	4 370 478 000	EUR	2 953 604	15. Okt. 2024	49 742
				EUR	2 327 919
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	169	USD	188	31. Okt. 2024	-
GBP	23 910 961	EUR	28 572 983	31. Okt. 2024	106 794
USD	249 241 618	EUR	224 358 443	31. Okt. 2024	(748 555)
				EUR	(641 761)
				EUR	1 686 158

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	21 573 000	USD	14 596 413	17. Okt. 2024	373 641
AUD	24 136 684	USD	16 324 805	21. Okt. 2024	425 405
AUD	126 000	USD	87 426	30. Okt. 2024	28
BRL	3 799 000	USD	694 902	04. Nov. 2024	(65)
CAD	816 770	USD	601 263	21. Okt. 2024	3 602
CAD	28 000	USD	20 757	30. Okt. 2024	(16)
CHF	774 000	EUR	799 442	21. Okt. 2024	26 734
CHF	2 639 846	JPY	440 464 312	21. Okt. 2024	48 638
CHF	12 359 675	USD	14 050 460	21. Okt. 2024	635 937
CLP	10 699 000	USD	11 945	24. Okt. 2024	(32)
CLP	527 285 000	USD	566 200	21. Nov. 2024	20 794
COP	5 031 413 000	USD	1 203 952	24. Okt. 2024	(2 278)
DKK	33 541 099	USD	4 908 536	21. Okt. 2024	118 341
EUR	80 564	CHF	78 000	21. Okt. 2024	(2 694)
EUR	38 712 769	USD	42 505 099	21. Okt. 2024	736 827
EUR	510 000	USD	570 572	30. Okt. 2024	(660)
GBP	38 000	EUR	44 949	21. Okt. 2024	762
GBP	2 140 000	USD	2 766 407	17. Okt. 2024	104 049
GBP	24 694 739	USD	32 036 183	21. Okt. 2024	1 087 643
GBP	790 000	USD	1 057 522	30. Okt. 2024	2 123
HKD	323 821 103	USD	41 587 607	21. Okt. 2024	111 767
IDR	4 178 498 000	USD	275 263	24. Okt. 2024	459
INR	767 438 527	USD	9 160 929	21. Okt. 2024	(11 372)
INR	13 214 000	USD	157 521	24. Okt. 2024	(5)
JPY	918 000 942	CHF	5 119 119	21. Okt. 2024	353 444
JPY	5 230 296 952	USD	34 642 816	21. Okt. 2024	2 027 588
JPY	5 844 000	USD	41 042	30. Okt. 2024	(9)
MXN	1 245 000	USD	63 302	30. Okt. 2024	(81)
NOK	452 000	EUR	38 597	21. Okt. 2024	(189)
NOK	26 511 388	USD	2 446 351	21. Okt. 2024	71 261
NOK	5 378 000	USD	511 309	30. Okt. 2024	(542)
NZD	282 000	USD	171 626	17. Okt. 2024	7 801
NZD	111 000	USD	70 636	30. Okt. 2024	(6)
SEK	16 360 020	USD	1 560 945	21. Okt. 2024	54 601
SEK	7 397 000	USD	732 214	30. Okt. 2024	(1 406)
SGD	6 565 000	USD	4 920 587	17. Okt. 2024	204 376
SGD	9 180 934	USD	6 885 183	21. Okt. 2024	283 591
TRY	16 770 000	USD	371 180	14. Mai 2025	20 949
USD	662 993	AUD	1 017 000	17. Okt. 2024	(42 729)
USD	3 955 125	AUD	5 827 462	21. Okt. 2024	(88 978)
USD	2 861 855	BRL	15 566 489	21. Okt. 2024	10 070
USD	70 606	BRL	386 000	04. Nov. 2024	7
USD	122 668	CAD	166 274	21. Okt. 2024	(467)
USD	512 250	CAD	691 000	30. Okt. 2024	406
USD	3 093 378	CHF	2 661 577	21. Okt. 2024	(69 243)
USD	156 981	CHF	132 000	30. Okt. 2024	(50)
USD	23 618	CLP	21 154 000	24. Okt. 2024	63
USD	1 482 167	DKK	10 035 499	21. Okt. 2024	(21 876)
USD	13 578 434	EUR	12 358 763	21. Okt. 2024	(226 233)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
USD	1 085 885	EUR	975 000	17. Dez. 2024	(5 673)
USD	440 700	GBP	337 000	17. Okt. 2024	(11 330)
USD	22 816 122	GBP	17 561 584	21. Okt. 2024	(739 776)
USD	10 947 375	HKD	85 233 291	21. Okt. 2024	(28 363)
USD	134 121	HUF	47 716 000	30. Okt. 2024	187
USD	62 907	IDR	954 929 000	24. Okt. 2024	(105)
USD	23 167	ILS	86 000	30. Okt. 2024	32
USD	22 949 656	JPY	3 388 506 203	21. Okt. 2024	(807 678)
USD	157 621	JPY	22 444 000	30. Okt. 2024	36
USD	181 948	KRW	238 732 000	24. Okt. 2024	(871)
USD	359 679	MXN	6 710 000	29. Okt. 2024	18 889
USD	57 862	MXN	1 138 000	30. Okt. 2024	74
USD	196 339	MYR	812 000	24. Okt. 2024	(840)
USD	1 249 477	NOK	13 331 326	21. Okt. 2024	(16 511)
USD	315 636	NZD	496 000	30. Okt. 2024	28
USD	6 475	RON	29 713	21. Okt. 2024	(188)
USD	512 473	SEK	5 260 316	21. Okt. 2024	(6 981)
USD	591 974	SGD	783 000	17. Okt. 2024	(19 275)
USD	928 317	SGD	1 216 258	21. Okt. 2024	(21 378)
USD	669 700	SGD	857 000	30. Okt. 2024	172
USD	473 137	TWD	14 927 000	24. Okt. 2024	484
USD	94 070	ZAR	1 623 668	21. Okt. 2024	8
USD	532 872	ZAR	9 925 000	29. Okt. 2024	(41 668)
USD	133 303	ZAR	2 301 000	30. Okt. 2024	115
ZAR	9 925 000	USD	566 503	29. Okt. 2024	8 036
ZAR	1 839 000	USD	106 538	30. Okt. 2024	(92)
USD					4 589 308
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	928 578	USD	1 095 850	31. Okt. 2024	8 957
EUR	202 922 528	USD	225 439 382	31. Okt. 2024	1 332 016
GBP	28 007 076	USD	37 165 120	31. Okt. 2024	401 344
JPY	1 214 542	USD	8 503	31. Okt. 2024	26
SEK	63 217	USD	6 185	31. Okt. 2024	59
SGD	30 578	USD	23 698	30. Okt. 2024	191
USD	6 752	CHF	5 714	31. Okt. 2024	(46)
USD	1 176 767	EUR	1 055 894	31. Okt. 2024	(3 223)
USD	569 065	GBP	425 359	31. Okt. 2024	(1 476)
USD	50	JPY	7 100	31. Okt. 2024	–
USD	29	SEK	297	31. Okt. 2024	–
USD	109	SGD	141	30. Okt. 2024	(1)
USD					1 737 847
USD					6 327 155
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	187 054	USD	127 017	17. Okt. 2024	2 335
EUR	3 756 861	USD	4 098 769	17. Okt. 2024	85 923
GBP	42 347	USD	55 170	17. Okt. 2024	1 445
JPY	21 142 133	USD	148 710	17. Okt. 2024	(1 280)
USD	951 554	AUD	1 402 396	17. Okt. 2024	(18 239)
USD	24 774 434	EUR	22 867 723	17. Okt. 2024	(697 458)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)					
USD	3 419 900	GBP	2 667 623	17. Okt. 2024	(146 556)
USD	270 371	JPY	42 924 633	17. Okt. 2024	(28 955)
					USD (802 785)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	470 220	USD	554 923	31. Okt. 2024	2 686
EUR	14 817 060	USD	16 461 300	31. Okt. 2024	54 198
GBP	2 229 035	USD	2 957 930	31. Okt. 2024	22 134
USD	10 732	EUR	9 634	31. Okt. 2024	(6)
USD	22 650	GBP	16 886	31. Okt. 2024	75
					USD 79 087
					USD (723 698)
Schroder GAIA SEG US Equity					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2 320 350	USD	2 738 594	31. Okt. 2024	12 999
EUR	165 780 557	USD	184 188 473	31. Okt. 2024	595 037
GBP	14 878 708	USD	19 745 482	31. Okt. 2024	146 313
USD	30 164	CHF	25 533	31. Okt. 2024	(115)
USD	2 174 177	EUR	1 950 470	31. Okt. 2024	129
USD	202 546	GBP	151 953	31. Okt. 2024	(600)
					USD 753 763
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CAD	365 000	USD	269 437	18. Dez. 2024	990
CHF	321 000	USD	381 452	18. Dez. 2024	1 146
DKK	5 537 000	USD	830 877	18. Dez. 2024	(687)
EUR	305 000	USD	341 618	18. Dez. 2024	(1 025)
GBP	475 000	USD	634 472	18. Dez. 2024	468
USD	270 535	CAD	365 000	18. Dez. 2024	107
USD	346 419	DKK	2 310 000	18. Dez. 2024	69
USD	15 288 550	EUR	13 678 000	18. Dez. 2024	14 350
USD	18 354 675	GBP	13 899 000	18. Dez. 2024	(224 317)
					USD (208 899)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2 716 000	USD	3 205 255	31. Okt. 2024	15 519
EUR	26 807 901	USD	29 782 812	31. Okt. 2024	98 000
GBP	4 075 858	USD	5 408 553	31. Okt. 2024	40 586
USD	233	CHF	197	31. Okt. 2024	(1)
USD	5 263	EUR	4 721	31. Okt. 2024	1
USD	235 484	GBP	176 792	31. Okt. 2024	(875)
					USD 153 230
					USD (55 669)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	12 356 865	USD	8 304 285	18. Dez. 2024	245 452
CAD	5 385 375	USD	3 985 854	18. Dez. 2024	4 154
CHF	8 533 210	USD	10 186 367	18. Dez. 2024	(15 687)
CNH	6 472 350	USD	924 142	18. Dez. 2024	5 434
GBP	11 794 616	USD	15 495 707	18. Dez. 2024	270 326
IDR	81 633 000 000	USD	5 290 195	15. Okt. 2024	98 561

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)					
ILS	532 724	USD	144 259	18. Dez. 2024	(1 015)
JPY	1 276 213 514	USD	8 893 053	18. Dez. 2024	82 346
KRW	1 260 721 680	USD	951 000	18. Dez. 2024	17 532
MXN	85 306 661	USD	4 228 918	18. Dez. 2024	51 358
NOK	13 392 484	USD	1 250 482	18. Dez. 2024	19 123
NZD	10 220 921	USD	6 319 911	18. Dez. 2024	174 267
PLN	22 487 660	USD	5 794 878	18. Dez. 2024	33 466
SEK	13 828 772	USD	1 347 711	18. Dez. 2024	19 236
SGD	5 098 469	USD	3 924 515	18. Dez. 2024	57 840
TWD	5 753 048	USD	180 976	18. Dez. 2024	2 043
USD	5 599 522	AUD	8 332 049	18. Dez. 2024	(165 438)
USD	10 653 828	CAD	14 394 369	18. Dez. 2024	(10 920)
USD	8 561 482	CHF	7 170 335	18. Dez. 2024	15 205
USD	4 308 460	CNH	30 199 400	18. Dez. 2024	(28 861)
USD	1 629 668	CZK	36 861 741	18. Dez. 2024	(1 099)
USD	3 332 737	EUR	3 000 000	18. Dez. 2024	(17 357)
USD	8 135 212	GBP	6 200 913	18. Dez. 2024	(153 636)
USD	671 224	HUF	239 934 747	18. Dez. 2024	790
USD	516 624	ILS	1 908 000	18. Dez. 2024	3 581
USD	10 293 563	JPY	1 483 181 464	18. Dez. 2024	(137 408)
USD	3 500 876	KRW	4 644 331 120	18. Dez. 2024	(67 066)
USD	3 951 715	MXN	79 755 660	18. Dez. 2024	(50 039)
USD	2 224 757	NOK	23 824 536	18. Dez. 2024	(33 804)
USD	1 681 312	NZD	2 718 759	18. Dez. 2024	(46 136)
USD	4 231 660	PLN	16 415 680	18. Dez. 2024	(22 950)
USD	1 725 179	SEK	17 694 924	18. Dez. 2024	(23 929)
USD	1 676 794	SGD	2 178 413	18. Dez. 2024	(24 739)
USD	300 000	TWD	9 467 072	18. Dez. 2024	(1 171)
USD	1 323 500	ZAR	23 953 911	18. Dez. 2024	(53 762)
ZAR	27 635 984	USD	1 527 061	18. Dez. 2024	61 906
					USD 307 603
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	38 974 733	USD	6 965 959	31. Okt. 2024	162 952
CHF	2 110 963	USD	2 491 276	31. Okt. 2024	12 016
EUR	81 137 600	USD	90 161 857	31. Okt. 2024	276 315
GBP	18 821 761	USD	24 977 186	31. Okt. 2024	186 202
USD	114 792	BRL	640 967	31. Okt. 2024	(2 448)
USD	37 561	CHF	31 490	31. Okt. 2024	219
USD	1 278 026	EUR	1 140 014	31. Okt. 2024	7 336
USD	361 635	GBP	269 407	31. Okt. 2024	1 456
					USD 644 048
					USD 951 651

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Absicherung des Portfolios

AUD	29 161 787	USD	19 682 744	02. Okt. 2024	478 262
AUD	615 000	USD	407 253	10. Okt. 2024	17 983
AUD	12 303 518	USD	8 503 727	04. Nov. 2024	6 885
AUD	734 000	USD	494 225	18. Dez. 2024	13 630
AUD	529 000	USD	360 090	24. Mrz. 2025	5 771
BRL	29 232 000	USD	5 298 004	02. Okt. 2024	67 928

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
BRL	5 774 000	USD	1 088 888	03. Okt. 2024	(29 125)
BRL	11 000	USD	2 004	31. Okt. 2024	8
BRL	10 185 000	USD	1 864 844	04. Nov. 2024	(2 740)
BRL	7 776 000	USD	1 393 432	03. Dez. 2024	23 631
BRL	1 162 000	USD	204 714	02. Jan. 2025	6 215
CAD	28 955 865	USD	21 435 011	02. Okt. 2024	(25 076)
CAD	832 000	USD	613 208	09. Okt. 2024	2 062
CAD	13 717 576	USD	10 156 884	04. Nov. 2024	(5 831)
CAD	770 000	USD	567 841	18. Dez. 2024	2 650
CHF	9 838 000	USD	11 658 362	02. Okt. 2024	(34 331)
CHF	7 245 000	USD	8 619 456	04. Nov. 2024	(24 314)
CLP	3 023 233 000	USD	3 261 973	02. Okt. 2024	99 789
CLP	385 085 000	USD	412 622	25. Nov. 2024	15 415
CLP	270 200 000	USD	292 172	18. Dez. 2024	8 103
CNH	92 871 000	USD	13 185 947	08. Okt. 2024	74 228
CNH	17 490 000	USD	2 511 391	04. Nov. 2024	(7 880)
CNH	2 552 000	USD	361 281	18. Dez. 2024	5 244
COP	45 222 421 000	USD	11 040 606	02. Okt. 2024	(288 849)
COP	30 249 121 000	USD	7 217 489	01. Nov. 2024	(56 120)
COP	2 523 843 000	USD	605 529	25. Nov. 2024	(9 717)
COP	90 300 000	USD	21 363	18. Dez. 2024	(106)
CZK	18 530 000	USD	823 409	02. Okt. 2024	(5 296)
CZK	15 290 000	USD	676 301	04. Nov. 2024	(755)
CZK	8 238 000	USD	364 641	18. Dez. 2024	(191)
DKK	7 020 000	USD	1 050 774	31. Okt. 2024	(718)
DKK	1 165 000	USD	172 752	18. Dez. 2024	1 922
EGP	11 060 000	USD	222 961	15. Okt. 2024	4 811
EGP	5 530 000	USD	106 040	22. Okt. 2024	7 497
EGP	5 530 000	USD	108 644	29. Okt. 2024	4 545
EGP	18 480 000	USD	365 595	18. Dez. 2024	4 685
EUR	1 203 220	CHF	1 135 000	31. Okt. 2024	(4 802)
EUR	438 741	NOK	5 170 000	31. Okt. 2024	(1 041)
EUR	3 719 731	SEK	42 050 000	31. Okt. 2024	(683)
EUR	24 684 000	USD	27 480 615	02. Okt. 2024	(3 635)
EUR	28 000	USD	31 231	08. Okt. 2024	(56)
EUR	220 000	USD	240 834	15. Okt. 2024	4 196
EUR	10 758 755	USD	12 010 899	31. Okt. 2024	(18 898)
EUR	2 339 000	USD	2 612 557	04. Nov. 2024	(5 041)
EUR	753 000	USD	842 116	18. Dez. 2024	(1 244)
EUR	717 000	USD	801 463	31. Jan. 2025	560
GBP	4 509 000	EUR	5 401 590	31. Okt. 2024	7 461
GBP	19 326 000	USD	25 481 276	02. Okt. 2024	356 622
GBP	4 843 000	USD	6 483 420	04. Nov. 2024	(8 725)
GBP	272 000	USD	354 907	18. Dez. 2024	8 680
HKD	751 000	USD	96 608	31. Okt. 2024	37
HUF	1 646 400 000	USD	4 644 317	02. Okt. 2024	(31 454)
HUF	241 400 000	USD	677 278	04. Nov. 2024	(1 831)
HUF	363 835 000	USD	1 009 378	18. Dez. 2024	7 261
HUF	268 016 000	USD	735 036	31. Jan. 2025	12 672
HUF	270 412 000	USD	756 892	25. Mrz. 2025	(4 131)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
IDR	12 025 000 000	USD	778 242	02. Okt. 2024	16 012
IDR	3 082 000 000	USD	203 534	04. Nov. 2024	(259)
IDR	4 326 000 000	USD	285 733	18. Dez. 2024	(888)
ILS	33 902 000	USD	9 178 240	07. Okt. 2024	(83 558)
ILS	4 215 000	USD	1 137 582	04. Nov. 2024	(5 962)
INR	2 015 042 000	USD	24 054 685	03. Okt. 2024	(10 219)
INR	8 630 000	USD	103 009	31. Okt. 2024	(172)
INR	2 013 762 000	USD	24 026 633	04. Nov. 2024	(34 997)
INR	106 603 000	USD	1 265 006	18. Dez. 2024	2 183
JPY	3 111 295 000	USD	21 696 452	02. Okt. 2024	(48 893)
JPY	36 900 000	USD	257 068	31. Okt. 2024	822
JPY	193 800 000	USD	1 354 221	01. Nov. 2024	438
JPY	7 299 000	USD	51 959	18. Dez. 2024	(626)
KRW	10 454 505 000	USD	7 859 029	02. Okt. 2024	135 547
KRW	85 880 000	USD	64 621	31. Okt. 2024	1 174
KRW	4 923 450 000	USD	3 736 214	04. Nov. 2024	36 574
KZT	248 600 000	USD	519 491	18. Dez. 2024	(12 348)
MXN	225 120 000	USD	11 495 634	02. Okt. 2024	(62 419)
MXN	137 710 000	USD	7 197 512	07. Okt. 2024	(209 083)
MXN	48 137 000	USD	2 576 121	23. Okt. 2024	(139 755)
MXN	137 690 000	USD	6 992 097	04. Nov. 2024	(36 795)
MXN	97 733 000	USD	5 240 423	13. Nov. 2024	(310 282)
MXN	1 460 000	USD	79 607	06. Dez. 2024	(6 216)
MXN	31 850 000	USD	1 608 324	18. Dez. 2024	(10 245)
MXN	145 870 000	USD	8 045 826	20. Dez. 2024	(729 031)
MXN	1 344 000	USD	70 886	24. Dez. 2024	(3 513)
MXN	80 153 000	USD	4 490 742	10. Jan. 2025	(483 319)
MXN	47 355 000	USD	2 591 319	21. Jan. 2025	(227 731)
MXN	47 355 000	USD	2 595 292	29. Jan. 2025	(234 624)
MXN	2 310 000	USD	118 280	18. Feb. 2025	(3 480)
MXN	107 000 000	USD	5 928 142	24. Feb. 2025	(615 479)
MXN	90 890 000	USD	5 147 096	20. Mrz. 2025	(650 913)
MXN	48 137 000	USD	2 675 095	23. Apr. 2025	(306 146)
MXN	97 733 000	USD	5 498 745	13. Mai 2025	(703 610)
NGN	106 611 000	USD	66 424	15. Okt. 2024	(3 212)
NGN	131 609 000	USD	78 199	24. Okt. 2024	(713)
NGN	222 189 000	USD	131 901	13. Jan. 2025	(8 196)
NOK	108 958 000	USD	10 132 698	02. Okt. 2024	192 189
NOK	50 210 000	USD	4 753 241	04. Nov. 2024	6 351
NZD	41 581 000	USD	25 797 889	02. Okt. 2024	618 511
NZD	18 046 000	USD	11 470 542	04. Nov. 2024	(4 610)
NZD	370 000	USD	230 257	18. Dez. 2024	4 834
PEN	9 175 000	USD	2 452 313	02. Okt. 2024	22 837
PEN	3 263 000	USD	875 895	04. Nov. 2024	3 876
PEN	3 280 000	USD	873 020	18. Dez. 2024	11 117
PHP	75 330 000	USD	1 337 939	02. Okt. 2024	6 339
PHP	40 800 000	USD	728 832	04. Nov. 2024	(879)
PHP	12 700 000	USD	227 313	18. Dez. 2024	(742)
PLN	55 545 473	USD	14 393 108	02. Okt. 2024	38 035
PLN	2 000	USD	522	31. Okt. 2024	(3)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
PLN	26 803 473	USD	6 980 447	04. Nov. 2024	(22 118)
PLN	2 977 000	USD	766 033	18. Dez. 2024	5 545
SEK	147 613 000	USD	14 400 956	02. Okt. 2024	133 818
SGD	3 258 872	USD	2 510 821	02. Okt. 2024	24 773
SGD	455 000	USD	354 876	30. Okt. 2024	(308)
SGD	285 000	USD	220 988	18. Dez. 2024	1 622
THB	131 920 000	USD	3 902 089	02. Okt. 2024	197 669
THB	1 772 000	USD	48 655	21. Okt. 2024	6 491
THB	282 000	USD	8 618	31. Okt. 2024	164
THB	3 800 000	USD	118 071	04. Nov. 2024	308
THB	89 610 000	USD	2 694 242	18. Dez. 2024	105 103
THB	1 652 000	USD	46 275	21. Jan. 2025	5 435
TRY	159 240 000	USD	4 501 802	02. Okt. 2024	154 678
TRY	159 240 000	USD	4 495 671	04. Nov. 2024	(7 822)
TRY	49 977 000	USD	1 324 578	18. Dez. 2024	18 069
TRY	172 515 000	USD	3 585 085	18. Sep. 2025	34 361
TWD	308 157 000	USD	9 701 776	02. Okt. 2024	35 699
TWD	12 625 000	USD	399 388	31. Okt. 2024	649
TWD	189 830 000	USD	5 999 666	04. Nov. 2024	17 362
USD	12 248 255	AUD	18 028 270	02. Okt. 2024	(215 592)
USD	952 159	AUD	1 399 000	10. Okt. 2024	(15 166)
USD	6 225 642	AUD	9 045 000	04. Nov. 2024	(30 982)
USD	639 026	AUD	955 000	18. Dez. 2024	(21 740)
USD	5 257 165	BRL	29 232 000	02. Okt. 2024	(108 771)
USD	1 027 157	BRL	5 774 000	03. Okt. 2024	(32 605)
USD	172 519	BRL	945 000	31. Okt. 2024	(332)
USD	2 161 821	BRL	11 787 000	04. Nov. 2024	6 827
USD	984 020	BRL	5 406 000	03. Dez. 2024	(1 144)
USD	1 567	BRL	9 000	06. Jan. 2025	(66)
USD	13 348 389	CAD	18 060 289	02. Okt. 2024	(5 369)
USD	411 131	CAD	557 000	09. Okt. 2024	(775)
USD	9 966 238	CAD	13 734 000	10. Okt. 2024	(190 416)
USD	19 978	CAD	27 000	04. Nov. 2024	(2)
USD	5 894 747	CAD	7 981 000	18. Dez. 2024	(18 353)
USD	126 550	CAD	173 000	14. Feb. 2025	(1 803)
USD	395 131	CAD	534 000	24. Mrz. 2025	(1 388)
USD	3 723 744	CHF	3 146 000	02. Okt. 2024	6 606
USD	219 288	CHF	185 000	31. Okt. 2024	(95)
USD	1 849 831	CHF	1 554 000	04. Nov. 2024	6 236
USD	434 811	CHF	367 000	18. Dez. 2024	(2 614)
USD	3 320 169	CLP	3 023 233 000	02. Okt. 2024	(41 594)
USD	6 593 815	CLP	5 935 633 000	04. Nov. 2024	(4 698)
USD	411 196	CLP	385 085 000	25. Nov. 2024	(16 841)
USD	780 117	CLP	729 300 000	18. Dez. 2024	(30 357)
USD	13 096 441	CNH	92 871 000	08. Okt. 2024	(163 732)
USD	940 489	CNH	6 549 000	04. Nov. 2024	3 068
USD	811 419	CNH	5 702 000	18. Dez. 2024	(7 518)
USD	226 181	CNY	1 573 000	18. Dez. 2024	492
USD	10 858 415	COP	45 222 421 000	02. Okt. 2024	106 660
USD	101 669	COP	426 100 000	01. Nov. 2024	790

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	608 775	COP	2 523 843 000	25. Nov. 2024	12 963
USD	22 000	COP	94 800 000	18. Dez. 2024	(316)
USD	5 989 010	CZK	134 925 000	02. Okt. 2024	31 977
USD	5 158 136	CZK	116 395 000	04. Nov. 2024	15 549
USD	1 067 239	DKK	7 130 000	31. Okt. 2024	729
USD	53 064 134	EUR	47 785 000	02. Okt. 2024	(127 709)
USD	31 714 296	EUR	28 408 295	31. Okt. 2024	49 640
USD	40 309 977	EUR	36 120 000	04. Nov. 2024	43 406
USD	4 868 998	EUR	4 392 000	18. Dez. 2024	(35 542)
USD	749 064	EUR	686 000	31. Jan. 2025	(18 282)
USD	756 850	EUR	676 000	25. Mrz. 2025	(759)
USD	22 980 199	GBP	17 458 000	02. Okt. 2024	(360 283)
USD	2 130 274	GBP	1 592 000	31. Okt. 2024	1 880
USD	2 605 814	GBP	1 947 000	04. Nov. 2024	2 834
USD	991 662	GBP	760 000	18. Dez. 2024	(24 241)
USD	265 285	HKD	2 060 000	31. Okt. 2024	190
USD	772	HKD	6 000	18. Dez. 2024	(1)
USD	11 696 647	HUF	4 156 893 000	02. Okt. 2024	49 920
USD	7 453 415	HUF	2 657 793 000	04. Nov. 2024	16 795
USD	827 931	HUF	294 600 000	18. Dez. 2024	4 751
USD	801 814	HUF	285 836 000	31. Jan. 2025	4 392
USD	778 882	IDR	12 025 000 000	02. Okt. 2024	(15 372)
USD	279 241	IDR	4 326 000 000	18. Dez. 2024	(5 604)
USD	9 164 674	ILS	33 902 000	07. Okt. 2024	69 992
USD	2 855 216	ILS	10 584 000	04. Nov. 2024	13 683
USD	24 075 955	INR	2 015 042 000	03. Okt. 2024	31 491
USD	15 272	INR	1 280 000	04. Nov. 2024	22
USD	159 931	INR	13 440 000	18. Dez. 2024	170
USD	241 146	INR	20 413 000	18. Feb. 2025	(562)
USD	23 083 568	JPY	3 297 458 000	02. Okt. 2024	140 741
USD	2 826 172	JPY	405 674 000	31. Okt. 2024	(9 032)
USD	5 262 119	JPY	747 663 000	01. Nov. 2024	35 963
USD	61 465	JPY	8 600 000	18. Dez. 2024	982
USD	7 867 971	KRW	10 454 505 000	02. Okt. 2024	(126 604)
USD	3 316 607	KRW	4 373 458 000	04. Nov. 2024	(34 728)
USD	236 120	KZT	114 400 000	18. Dez. 2024	2 745
USD	12 602 809	MXN	245 840 000	02. Okt. 2024	117 283
USD	230 790	MXN	3 981 000	04. Okt. 2024	28 670
USD	7 747 489	MXN	137 710 000	07. Okt. 2024	759 058
USD	2 749 429	MXN	48 137 000	23. Okt. 2024	313 063
USD	6 059 706	MXN	119 110 000	04. Nov. 2024	42 957
USD	5 650 562	MXN	97 733 000	13. Nov. 2024	720 421
USD	4 528 723	MXN	89 777 000	18. Dez. 2024	24 148
USD	8 360 821	MXN	145 870 000	20. Dez. 2024	1 044 026
USD	4 286 486	MXN	80 153 000	10. Jan. 2025	279 063
USD	2 495 784	MXN	47 355 000	21. Jan. 2025	132 195
USD	2 494 666	MXN	47 355 000	29. Jan. 2025	133 998
USD	5 789 887	MXN	107 000 000	24. Feb. 2025	477 224
USD	4 842 639	MXN	90 890 000	20. Mrz. 2025	346 454
USD	2 503 432	MXN	48 137 000	23. Apr. 2025	134 483

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	5 092 661	MXN	97 733 000	13. Mai 2025	297 527
USD	12 932 512	NOK	136 179 000	02. Okt. 2024	28 159
USD	3 257 786	NOK	34 311 000	04. Nov. 2024	5 320
USD	19 877 946	NZD	31 933 000	02. Okt. 2024	(409 083)
USD	386 280	NZD	608 000	04. Nov. 2024	(27)
USD	448 644	NZD	730 000	18. Dez. 2024	(15 184)
USD	2 441 551	PEN	9 175 000	02. Okt. 2024	(33 597)
USD	1 630 959	PEN	6 090 000	04. Nov. 2024	(11 029)
USD	1 723 192	PEN	6 503 000	18. Dez. 2024	(29 716)
USD	1 338 813	PHP	75 330 000	02. Okt. 2024	(5 465)
USD	7 383 277	PLN	28 742 000	02. Okt. 2024	(84 119)
USD	239 251	PLN	940 000	15. Okt. 2024	(4 900)
USD	1 974 738	PLN	7 580 000	04. Nov. 2024	6 928
USD	180 571	PLN	695 000	18. Dez. 2024	441
USD	99 835	PLN	394 000	21. Jan. 2025	(2 106)
USD	27 181 666	SEK	277 486 000	02. Okt. 2024	(141 111)
USD	673 754	SEK	6 810 000	31. Okt. 2024	2 180
USD	16 281 775	SEK	164 342 000	04. Nov. 2024	72 043
USD	4 390 950	SGD	5 725 000	02. Okt. 2024	(63 435)
USD	780	SGD	1 000	30. Okt. 2024	1
USD	1 928 232	SGD	2 466 128	04. Nov. 2024	5 960
USD	3 788 148	THB	128 120 000	02. Okt. 2024	(193 517)
USD	117 664	THB	3 850 000	31. Okt. 2024	(2 243)
USD	284 900	THB	9 500 000	18. Dez. 2024	(11 872)
USD	4 590 994	TRY	172 517 000	18. Dez. 2024	(43 726)
USD	9 648 876	TWD	308 157 000	02. Okt. 2024	(88 599)
USD	14 143	TWD	450 000	31. Okt. 2024	(115)
USD	26 609 731	ZAR	472 837 000	02. Okt. 2024	(757 482)
USD	64 607	ZAR	1 249 000	21. Okt. 2024	(7 561)
USD	20 012 604	ZAR	344 563 000	04. Nov. 2024	128 698
USD	32 580	ZAR	617 000	06. Dez. 2024	(2 933)
USD	3 195 468	ZAR	57 579 000	18. Dez. 2024	(115 112)
USD	32 208	ZAR	589 000	24. Dez. 2024	(1 640)
ZAR	136 824 000	USD	7 774 787	02. Okt. 2024	144 416
ZAR	59 066 000	USD	3 411 018	04. Nov. 2024	(2 460)
ZAR	13 833 000	USD	791 362	18. Dez. 2024	3 986
					USD (252 242)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	62 882 662	USD	11 228 390	31. Okt. 2024	273 547
CHF	9 942 549	USD	11 733 600	31. Okt. 2024	56 799
EUR	68 670 063	USD	76 289 383	31. Okt. 2024	252 133
GBP	46 199 425	USD	61 306 226	31. Okt. 2024	459 199
SGD	2 704 945	USD	2 096 332	30. Okt. 2024	11 553
USD	174 068	BRL	971 952	31. Okt. 2024	(3 713)
USD	4 717	CHF	3 990	31. Okt. 2024	(16)
USD	228 084	EUR	204 736	31. Okt. 2024	(121)
USD	25	SGD	34	30. Apr. 2024	-
					USD 1 049 381
					USD 797 139

Die Devisenterminkontrakte bezogen sich auf die folgenden Kontrahenten:

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
S Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Barclays Bank	(8 967)
	BNP Paribas	(58 286)
	Canadian Imperial Bank of Commerce	52 263
	Citi Bank	350 786
	HSBC	306 093
	J.P. Morgan	21 735
	Royal Bank of Canada	59 596
	Standard Chartered Bank	29 328
	State Street	205 804
	The Bank of New York Mellon	20 295
	UBS	143 607
	USD	1 122 254
S Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	1 923 873
	UBS	3 027 414
	USD	4 951 287
S Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	(1 083 346)
	HSBC	12 814 742
	USD	11 731 396
S Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	1 371 824
	Morgan Stanley	(47 531)
	USD	1 324 293
S Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	2 270 995
	HSBC	(584 837)
	EUR	1 686 158
S Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	458 275
	HSBC	1 737 847
	J.P. Morgan	4 131 033
	USD	6 327 155
S Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	79 087
	State Street	(802 785)
	USD	(723 698)
S Schroder GAIA SEG US Equity	HSBC	753 763
	USD	753 763
S Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	153 230
	Morgan Stanley	(208 899)
	USD	(55 669)
S Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	92 413
	Deutsche Bank	402 793
	HSBC	644 048
	Morgan Stanley	(48 662)
	Newedge Group	(138 941)
	USD	951 651

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schröder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	(296 807)
	Barclays Bank	757 135
	BNP Paribas	58 266
	Citi Bank	(567 378)
	Deutsche Bank	(205 725)
	Goldman Sachs	192 165
	HSBC	2 211 556
	J.P. Morgan	(57 590)
	Morgan Stanley	(1 454 200)
	Standard Chartered Bank	(19 276)
	UBS	178 993
	USD	797 139

Kassageschäfte

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

Zum 30. September 2024 war der folgende Teilfonds in offenen Kassageschäften engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schröder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
USD	251 000	AUD	362 000	02. Okt. 2024	731
USD	93 569	GBP	70 000	03. Okt. 2024	(17)
USD					714

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schröder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	(17)
	Morgan Stanley	731
	USD	714

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten“ aufgeführt. Zum 30. September 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)
Schröder GAIA BlueTrend							
Jun. 25	335	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	60 062 784	97,18	115 596
Sep. 25	70	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(12 546 896)	97,41	(57 451)
Dez. 25	65	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(11 675 524)	97,50	(39 327)
Mrz. 26	48	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(8 649 331)	97,54	(5 185)
Jun. 25	19	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	5 169 872	98,03	13 427
Sep. 25	27	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	7 352 439	98,16	22 694
Dez. 25	30	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	8 179 551	98,19	17 964
Mrz. 27	339	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	92 316 352	97,99	126 885
Sep. 25	26	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	6 299 688	96,79	(8 338)
Dez. 25	30	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	7 279 400	96,94	(9 275)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Mrz. 26	30	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	7 283 213	97,00	(8 213)
Jun. 27	73	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	17 696 713	96,93	(6 988)
Sep. 27	77	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	18 656 350	96,90	(3 100)
Dez. 27	84	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	20 349 400	96,88	(5 650)
Mrz. 28	90	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	21 796 713	96,85	(6 588)
Jun. 28	88	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	21 298 263	96,82	1 038
Sep. 28	94	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	22 744 175	96,79	300
Dez. 28	84	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	20 327 050	96,76	(8 500)
Dez. 24	265	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	181 361 411	9,90	(35 983)
Mrz. 25	257	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	176 026 485	9,91	(20 400)
Jun. 25	265	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	181 611 519	9,91	2 004
Sep. 25	49	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(33 526 648)	9,92	(68 681)
Okt. 24	7	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	1 428 761	912,00	(7 492)
Dez. 24	138	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	11 202 093	116,40	(97 157)
Dez. 24	235	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	17 450 055	107,18	(36 963)
Okt. 24	76	BIST 30 Index Futures	Morgan Stanley	TRY	(247 557)	11 149,50	(228)
Okt. 24	14	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	1 206 733	7 649,50	(14 627)
Dez. 24	416	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	38 306 318	125,01	145 499
Dez. 24	105	Canada 2 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	8 167 570	105,25	3 712
Dez. 24	476	Canada 5 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	40 403 194	115,44	226 360
Okt. 24	9	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(163 960)	18,84	(5 623)
Nov. 24	18	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(320 500)	18,10	(5 255)
Dez. 24	17	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	8 941 989	19 503,00	284 660
Dez. 24	22	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	4 617 410	42 643,00	73 320
Dez. 24	16	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	4 603 613	5 814,25	47 788
Dez. 24	11	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Morgan Stanley	EUR	1 681 435	136,28	(12 734)
Dez. 24	64	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	3 521 817	5 030,00	61 635
Dez. 24	68	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	9 039 145	120,05	47 943
Dez. 24	229	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	30 261 461	121,47	702 620
Dez. 24	65	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	9 734 018	134,92	28 085
Dez. 24	329	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	46 500 783	126,84	(48 634)
Dez. 24	22	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	2 459 406	8 288,50	(21 518)
Okt. 24	629	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(7 973 003)	13 900,00	(770 097)
Dez. 24	45	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	8 439 057	34 053,00	89 815
Okt. 24	105	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	7 996 644	1 866,00	(159 444)
Dez. 24	153	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	6 676 520	79 617,00	373 922
Okt. 24	7	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	919 782	21 278,00	38 212
Okt. 24	12	Hang Seng TECH Index Future	Morgan Stanley	HKD	347 736	4 789,00	21 888
Okt. 24	10	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	459 296	7 555,00	26 628
Okt. 24	9	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	1 163 982	11 891,40	27 340
Sep. 25	48	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	15 418 860	96,29	28 527
Dez. 25	42	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	13 520 257	96,46	20 773
Mrz. 26	54	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	17 412 737	96,55	13 403
Jun. 27	228	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	73 532 682	96,57	59 595
Okt. 24	153	IFSC Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	8 009 823	26 006,50	(51 834)
Dez. 24	78	Japan 10 Year Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	78 391 894	144,65	110 106
Dez. 24	13	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(853 158)	347,90	(11 471)
Dez. 24	79	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	10 590 809	98,43	(194 727)
Okt. 24	1 447	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	7 324 001	132 581,00	(280 856)
Dez. 24	133	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	16 255 550	2 487,80	288 320
Dez. 24	157	MSCI Emerging Markets Index Future	Morgan Stanley	USD	8 767 408	1 172,70	438 288
Okt. 24	209	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	5 564 228	343,40	19 946
Dez. 24	3	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	1 201 790	20 261,25	13 885
Dez. 24	4	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	1 059 315	37 950,00	(3 131)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Dez. 24	2	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	269 925	37 840,00	(6 645)
Okt. 24	61	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	1 527 580	2 625,75	49 548
Dez. 24	13	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	1 460 125	2 249,20	1 855
Dez. 24	8	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2 496 400	3 148,60	22 480
Dez. 24	126	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	26 653 686	1 444,40	259 605
Dez. 24	469	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	2 696 931	914,70	(30 507)
Dez. 24	664	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	78 961 361	107,67	620 937
Dez. 24	546	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	49 163 646	117,38	(154 332)
Dez. 24	2 018	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	164 093 538	106,35	22 314
Dez. 24	216	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	30 595 624	8 306,00	413 082
Dez. 24	23	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	495 163	195,60	5 622
Dez. 24	24	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	3 432 032	12 206,00	29 231
Dez. 24	13	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	2 373 561	2 647,50	21 116
Dez. 24	20	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	(241 309)	2 358,00	(3 741)
							USD
							2 737 273
Schroder GAIA Helix							
Dez. 24	4	Australia 10 Year Bond Future	Goldman Sachs	AUD	323 623	116,40	(623)
Dez. 24	1	E-mini Nikkei 225 (YEN) Future	Goldman Sachs	JPY	26 587	37 950,00	(56)
Dez. 24	3	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(853 680)	5 814,25	(18 458)
Dez. 24	22	E-mini S&P 500 Future	J.P. Morgan	USD	(6 355 250)	5 814,25	(40 425)
Dez. 24	1	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Goldman Sachs	EUR	152 698	136,28	(603)
Dez. 24	7	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(378 387)	5 030,00	(14 574)
Dez. 24	23	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(653 855)	519,40	(12 773)
Dez. 24	2	Euro-Bund Future	Goldman Sachs	EUR	301 490	134,92	(335)
Dez. 24	65	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(7 248 788)	8 288,50	22 231
Dez. 24	19	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(1 066 727)	21 164,00	(12 029)
Okt. 24	3	FTSE China A50 Future	Goldman Sachs	USD	(41 376)	13 900,00	(324)
Dez. 24	2	FTSE MIB Mini Future	Goldman Sachs	EUR	76 176	34 053,00	(166)
Okt. 24	4	IFSC Nifty 50 Future	Goldman Sachs	USD	207 447	26 006,50	605
Dez. 24	2	Long Gilt Future	Goldman Sachs	GBP	264 675	98,43	(617)
Dez. 24	11	Micro E-mini Russell 2000 Future	Goldman Sachs	USD	123 059	2 249,20	647
Dez. 24	1	Mini Dax Index Future	Goldman Sachs	EUR	108 943	19 503,00	(112)
Okt. 24	2	Mini Hang Seng Index Future	Goldman Sachs	HKD	54 190	21 278,00	597
Dez. 24	1	Mini Topix Index Future	Goldman Sachs	JPY	18 549	2 647,50	(40)
Dez. 24	10	MSCI AC AXJ NTR Future	J.P. Morgan	USD	(581 030)	636,10	(55 070)
Dez. 24	12	MSCI Asia Future	Goldman Sachs	USD	(783 740)	671,20	(21 700)
Dez. 24	64	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(4 003 388)	671,20	(292 292)
Dez. 24	6	MSCI China Future	Goldman Sachs	USD	(132 420)	549,00	(32 280)
Dez. 24	332	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	7 332 176	549,00	1 781 224
Dez. 24	2	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(244 250)	2 487,80	(4 530)
Dez. 24	31	MSCI Emerging Markets Index Future	Goldman Sachs	USD	(1 708 992)	1 172,70	(108 693)
Dez. 24	7	MSCI Emerging Markets Index Future	J.P. Morgan	USD	(390 600)	1 172,70	(19 845)
Dez. 24	35	MSCI Europe Future	Goldman Sachs	EUR	(1 346 966)	348,30	(13 554)
Dez. 24	378	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(14 547 236)	348,30	(146 388)
Dez. 24	3	MSCI India Future	Goldman Sachs	USD	422 372	1 419,80	3 569
Dez. 24	37	MSCI India Future	J.P. Morgan	USD	5 209 249	1 419,80	44 011
Dez. 24	6	MSCI Switzerland Future	J.P. Morgan	CHF	(274 803)	3 913,00	(3 521)
Dez. 24	45	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(5 260 500)	11 848,00	(71 100)
Dez. 24	3	Nasdaq 100 E-mini Future	Goldman Sachs	USD	121 071	20 261,25	497
Okt. 24	3	OMXS30 Index Future	Goldman Sachs	SEK	77 704	2 625,75	8
Dez. 24	1	Russell 1000 E-mini Future	Goldman Sachs	USD	(93 600)	1 885,20	(660)
Dez. 24	2	Russell 2000 E-mini Future	Goldman Sachs	USD	146 300	1 457,40	(560)
Dez. 24	1	S&P/TSX 60 Index Future	Goldman Sachs	CAD	213 287	1 444,40	548
Dez. 24	9	S&P500 Micro E-mini Future	Goldman Sachs	USD	260 123	5 814,25	1 519

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)							
Dez. 24	1	SPI 200 Future	Goldman Sachs	AUD	143 572	8 306,00	486
Dez. 24	10	SPI 200 Future	J.P. Morgan	AUD	(1 428 466)	8 306,00	(12 106)
Dez. 24	12	Stoxx 600 Bank Future	Goldman Sachs	EUR	(134 576)	203,20	(1 493)
Dez. 24	61	Topix Index Future	Goldman Sachs	JPY	(10 812 843)	2 647,50	(477 531)
Dez. 24	31	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(5 512 968)	2 647,50	(224 762)
Dez. 24	6	US 10 Year Note Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	687 656	114,28	(1 969)
Dez. 24	3	US Long Bond Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	374 531	124,19	(1 969)
						USD	264 784
Schroder GAIA Oaktree Credit							
Dez. 24	100	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	20 772 682	104,12	51 537
Dez. 24	65	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	7 116 992	109,88	25 391
						USD	76 928
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Dez. 24	14	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(3 772 901)	97,16	(12 476)
Mrz. 25	1	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	270 537	97,72	1 405
Jun. 25	61	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(16 542 564)	98,03	(98 556)
Sep. 25	49	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	13 250 715	98,16	133 787
Dez. 25	34	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	9 235 991	98,19	54 526
Mrz. 25	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	9 366 413	95,96	(10 312)
Jun. 25	27	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(6 439 576)	96,49	(73 162)
Sep. 25	100	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(24 039 800)	96,79	(157 700)
Dez. 25	59	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(14 196 438)	96,94	(101 475)
Mrz. 26	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 353 663)	97,00	(103 837)
Jun. 26	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 429 525)	97,03	(30 413)
Sep. 26	15	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(3 640 775)	97,02	2 525
Dez. 26	26	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	6 266 925	97,00	37 750
Mrz. 27	19	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	4 607 500	96,96	(1 900)
Okt. 24	10	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(2 002 958)	912,00	(27 428)
Dez. 24	10	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	811 938	116,40	(7 232)
Dez. 24	7	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	519 345	107,18	(657)
Dez. 24	1	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(66 895)	69,25	(2 350)
Dez. 24	1	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	81 875	133,74	1 713
Okt. 24	25	CAC 40 Index Future	Citi Bank	EUR	2 081 173	7 649,50	47 587
Dez. 24	3	Canada 10 Year Bond Future	Citi Bank	CAD	277 215	125,01	81
Dez. 24	1	Canada 5 Year Bond Future	Citi Bank	CAD	(84 706)	115,44	(651)
Dez. 24	1	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(73 794)	74,09	(296)
Okt. 24	7	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	135 727	18,84	(3 829)
Nov. 24	5	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	97 770	18,10	(7 283)
Dez. 24	29	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	(15 234 539)	19 503,00	(505 040)
Dez. 24	54	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(11 216 610)	42 643,00	(297 000)
Dez. 24	159	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	45 327 477	5 814,25	895 810
Dez. 24	9	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Newedge Group	EUR	(1 331 572)	136,28	(33 728)
Dez. 24	97	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	5 281 624	5 030,00	149 546
Dez. 24	50	Euro Stoxx Banks Future	Morgan Stanley	EUR	401 277	144,70	1 405
Dez. 24	72	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(9 512 974)	120,05	(108 649)
Dez. 24	114	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	15 037 922	121,47	376 512
Dez. 24	45	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(6 652 685)	134,92	(105 694)
Dez. 24	27	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	(3 774 146)	126,84	(38 036)
Dez. 24	181	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(21 473 804)	107,18	(119 831)
Dez. 24	103	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	(11 535 037)	8 288,50	121 288
Okt. 24	317	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(3 880 943)	13 900,00	(525 357)
Dez. 24	22	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	4 128 451	34 053,00	41 220
Dez. 24	60	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2 630 530)	79 617,00	(134 350)
Okt. 24	12	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(1 565 178)	11 891,40	(23 251)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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.)							
Mrz. 25	4	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	1 276 453	95,51	468
Okt. 24	69	IFSC Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	3 600 169	26 006,50	(11 272)
Dez. 24	19	Japan 10 Year Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	19 078 240	144,65	44 042
Dez. 24	1	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	89 063	70,31	(1 181)
Dez. 24	38	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	(348 968)	1 293,80	(26 993)
Dez. 24	78	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(5 051 331)	347,90	(136 442)
Dez. 24	45	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	5 945 067	98,43	(23 247)
Dez. 24	3	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	74 445	5,03	960
Dez. 24	20	MSCI EAFE Index Future	Citi Bank	USD	(2 440 200)	2 487,80	(47 600)
Dez. 24	75	MSCI Emerging Markets Index Future	Citi Bank	USD	(4 112 625)	1 172,70	(285 000)
Okt. 24	33	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(883 439)	343,40	1 727
Dez. 24	97	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	38 365 367	20 261,25	941 458
Dez. 24	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(61 815)	63,55	(1 730)
Dez. 24	3	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	(760 063)	37 950,00	(32 075)
Dez. 24	11	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(1 377 631)	38 115,00	(80 936)
Okt. 24	42	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	(1 054 399)	2 625,75	(31 492)
Dez. 24	59	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(6 413 433)	2 249,20	(221 707)
Dez. 24	8	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2 411 920	3 148,60	106 960
Dez. 24	18	S&P/TSX 60 Index Future	Citi Bank	CAD	3 805 665	1 444,40	39 090
Dez. 24	62	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	356 259	914,70	(3 768)
Dez. 24	59	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	7 013 524	107,67	57 795
Dez. 24	127	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	(11 419 997)	117,38	20 395
Dez. 24	16	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1 299 870	106,35	1 346
Dez. 24	40	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	5 671 075	8 306,00	71 278
Dez. 24	1	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	11 218	203,20	92
Dez. 24	41	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	1 188 997	525,90	11 085
Dez. 24	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	148 104	119,11	777
Okt. 24	22	TAIEX Future	Morgan Stanley	TWD	3 025 822	22 326,00	78 294
Dez. 24	6	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	1 082 936	2 647,50	22 300
Dez. 24	55	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	6 280 188	114,28	5 281
Dez. 24	10	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(1 181 734)	118,30	(1 234)
Dez. 24	46	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(9 564 055)	104,12	(15 086)
Dez. 24	2	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	425 984	106,70	813
Dez. 24	86	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(9 435 141)	109,88	(14 781)
Okt. 24	10	US Dollar Future	Newedge Group	KRW	102 492	1 306,50	(2 584)
Dez. 24	1	US Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	101 243	100,52	(722)
Dez. 24	12	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1 493 625)	124,19	3 375
Dez. 24	10	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	1 330 166	133,09	771
Okt. 24	58	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(115 804)	19,05	(7 188)
Dez. 24	20	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(244 427)	2 358,00	(624)
						USD	(202 693)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Dez. 24	18	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1 335 090	107,18	(1 322)
Dez. 24	25	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(1 411 730)	5 030,00	11 944
Dez. 24	94	Euro Stoxx Banks Future	Morgan Stanley	EUR	(749 719)	144,70	(7 323)
Dez. 24	13	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	1 738 217	120,05	(980)
Dez. 24	15	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	2 259 661	134,92	(6 868)
Dez. 24	19	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(2 254 151)	107,18	(12 584)
Dez. 24	42	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(5 548 062)	98,43	21 030
Dez. 24	5	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	(901 451)	2 647,50	(19 579)
Dez. 24	22	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(2 530 276)	114,28	16 089
Dez. 24	48	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	10 008 898	104,12	(13 274)
Dez. 24	18	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1 964 008)	109,88	(13 883)
Dez. 24	5	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(625 750)	124,19	4 813
Dez. 24	9	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1 215 938)	133,09	18 094
						USD	(3 843)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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 30. September 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						
	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 54,64 Verfallstermin 01. Okt. 2024	UBS	USD	(16 293)	–	16 293
(4 083 398)				USD	–	16 293
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
	Put auf Trade Desk, Inc. Ausübungskurs 50,00 Verfallstermin 15. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	113 373	126 968	13 595
513				USD	126 968	13 595
Schroder GAIA Helix						
83	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 8 100,00 Verfallstermin 18. Okt. 2023	UBS	GBP	28 278	36 740	8 462
62	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 8 150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2023	UBS	GBP	36 051	36 800	749
20	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1 060,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	UBS	USD	11 074	2 500	(8 574)
16	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5 450,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	UBS	USD	60 860	17 680	(43 180)
25	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5 550,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	UBS	USD	89 633	45 625	(44 008)
				USD	139 345	(86 551)
Schroder GAIA SEG US Equity						
304	Call auf Citigroup Financial Group, Inc. Ausübungskurs 27,50 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	353 262	408 880	55 618
360	Call auf Estee Lauder Cos., Inc. Ausübungskurs 70,00 Verfallstermin 18. Jun. 2026	Goldman Sachs	USD	916 870	1 359 000	442 130
1 736	Call auf Pfizer, Inc. Ausübungskurs 35,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	383 587	343 728	(39 859)
468	Call auf Polaris, Inc. Ausübungskurs 70,00 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Goldman Sachs	USD	514 969	680 940	165 971
1 640	Call auf VF Corp. Ausübungskurs 17,50 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	324 764	914 300	589 536
346	Put auf DaVita, Inc. Ausübungskurs 110,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	352 627	330 430	(22 197)
80	Call auf Eli Lilly & Co. Ausübungskurs 510,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	126 162	183 200	57 038
295	Put auf ResMed, Inc. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 17. Apr. 2025	Goldman Sachs	USD	155 664	76 700	(78 964)
94	Put auf ResMed Inc. Ausübungskurs 220,00 Verfallstermin 15. Jan. 2027	Goldman Sachs	USD	339 415	352 500	13 085
				USD	4 649 678	1 182 358

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity						
1 156	Put auf GE Vernova, Inc. Ausübungskurs 210,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Goldman Sachs	USD	440 028	450 840	10 812
				USD	450 840	10 812
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
10	Call auf Adobe, Inc. Ausübungskurs 550,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	7 445	8 900	1 455
(10)	Call auf Adobe, Inc. Ausübungskurs 600,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 429)	(1 715)	(286)
31	Call auf Airbnb, Inc. Ausübungskurs 140,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3 324	946	(2 378)
20	Call auf Apple, Inc. Ausübungskurs 240,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3 740	4 870	1 130
31	Call auf Applied Materials, Inc. Ausübungskurs 230,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5 451	2 356	(3 095)
36	Call auf Astera Labs, Inc. Ausübungskurs 55,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 714	8 910	1 196
(36)	Call auf Astera Labs, Inc. Ausübungskurs 65,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 752)	(1 890)	(138)
365	Call auf AT&T, Inc. Ausübungskurs 23,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	14 409	6 935	(7 474)
41	Call auf Broadcom, Inc. Ausübungskurs 185,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9 449	3 628	(5 821)
11	Call auf CBOE Mini-SPX Index Ausübungskurs 592,00 Verfallstermin 15. Nov. 2021	Morgan Stanley	USD	5 251	6 023	772
21	Call auf Crown Castle, Inc. Ausübungskurs 125,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	3 595	4 357	762
26	Call auf Datadog, Inc. Ausübungskurs 124,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3 079	1 807	(1 272)
10	Call auf Domino's Pizza, Inc. Ausübungskurs 450,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 865	13 950	6 085
(10)	Call auf Domino's Pizza, Inc. Ausübungskurs 480,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2 299)	(4 950)	(2 651)
26	Call auf DoorDash, Inc. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5 429	3 211	(2 218)
20	Call auf Expedia Group, Inc. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5 346	5 950	604
(1 970 000)	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,68 Verfallstermin 20. Mrz. 2025	Bank of America	AUD	(34 001)	(46 994)	(12 993)
1 970 000	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,71 Verfallstermin 20. Mrz. 2025	Bank of America	AUD	13 066	19 777	6 711
185 000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,62 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Bank of America	EUR	1 867	1 428	(439)
184 000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 670	8	(1 662)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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.)						
269 000	Call auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 393,74 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 932	2 688	756
1 609 000	Call auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 400,00 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Bank of America	EUR	31 173	34 802	3 629
(269 000)	Call auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,16 Verfallstermin 01. Okt. 2024	HSBC	EUR	(6 837)	(120)	6 717
(277 000)	Call auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,82 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Morgan Stanley	EUR	(3 075)	(1 304)	1 771
(277 000)	Call auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,83 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	(3 011)	(680)	2 331
185 000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,78 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 762	591	(1 171)
184 000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,80 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Barclays Bank	EUR	1 855	174	(1 681)
277 000	Call auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,29 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1 645	627	(1 018)
277 000	Call auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,29 Verfallstermin 15. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1 603	991	(612)
181 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Bank of America	EUR	2 495	3 645	1 150
185 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 09. Okt. 2024	UBS	EUR	1 320	1 658	338
184 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 381	1 084	(297)
185 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,12 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	EUR	2 537	2 405	(132)
155 000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,93 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 685	1 596	(89)
155 000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 591	327	(1 264)
156 000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 187,08 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	2 707	5 540	2 833
157 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 01. Nov. 2024	BNP Paribas	GBP	2 585	9 148	6 563
155 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 629	3 300	1 671
155 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 567	3 107	1 540
335 000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	NZD	3 340	7 679	4 339
(495 000)	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 09. Okt. 2024	HSBC	NZD	(3 550)	(10 388)	(6 838)
330 000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,62 Verfallstermin 23. Okt. 2024	HSBC	NZD	2 227	4 808	2 581

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
207 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,49 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	5 637	5 605	(32)
450 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,65 Verfallstermin 02. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	21 780	8 559	(13 221)
448 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 6,14 Verfallstermin 30. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	7 759	1 997	(5 762)
206 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 20. Dez. 2024	UBS	USD	2 014	2 092	78
207 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1 124	1 157	33
206 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1 004	648	(356)
199 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Verfallstermin 07. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	2 123	282	(1 841)
1 732 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Barclays Bank	USD	25 720	12 109	(13 611)
206 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,84 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	3 062	2 340	(722)
199 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,85 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	3 190	1 493	(1 697)
2 034 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,89 Verfallstermin 08. Nov. 2024	UBS	USD	21 052	499	(20 553)
308 000	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 946,65 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4 472	89	(4 383)
(311 000)	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,97 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	(2 092)	(2 925)	(833)
(309 000)	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,11 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1 794)	(81)	1 713
1 356 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,29 Verfallstermin 09. Mai 2025	Morgan Stanley	USD	11 960	6 375	(5 585)
1 356 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,35 Verfallstermin 05. Mrz. 2025	J.P. Morgan	USD	10 234	3 335	(6 899)
1 356 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,35 Verfallstermin 18. Feb. 2025	BNP Paribas	USD	12 611	3 033	(9 578)
1 356 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,37 Verfallstermin 22. Apr. 2025	BNP Paribas	USD	14 374	4 482	(9 892)
299 000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4 186,00 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4 899	1 788	(3 111)
307 000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4 226,00 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4 884	2 255	(2 629)
207 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,03 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	1 000	1 087	87
1 732 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,63 Verfallstermin 14. Feb. 2025	Goldman Sachs	USD	14 360	9 732	(4 628)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(207 000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,30 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	(4 624)	(5 269)	(645)
202 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 155,70 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Bank of America	USD	3 563	5	(3 558)
(479 000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,28 Verfallstermin 04. Dez. 2024	UBS	USD	(17 163)	(39 543)	(22 380)
(460 000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,87 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(18 561)	(27 919)	(9 358)
(866 000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,42 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Deutsche Bank	USD	(34 970)	(45 713)	(10 743)
309 000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,49 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	5 250	7 039	1 789
309 000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,17 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Deutsche Bank	USD	5 698	1 153	(4 545)
880 000	Call auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 3,94 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	24 033	11 154	(12 879)
(207 000)	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,06 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(4 022)	(4 597)	(575)
312 000	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,12 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	3 211	3 486	275
(307 000)	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,30 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1 827)	(67)	1 760
(312 000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 32,60 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	(3 253)	(2 082)	1 171
(299 000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 33,92 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2 989)	–	2 989
(1 056 000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 35,65 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Bank of America	USD	(23 057)	(1 412)	21 645
(1 391 000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 36,36 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	(30 744)	(2)	30 742
311 000	Call auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 31,36 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	2 879	4 119	1 240
(309 000)	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 17,37 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Bank of America	USD	(4 257)	(3 400)	857
460 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,20 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	18 982	4 685	(14 297)
479 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,84 Verfallstermin 04. Dez. 2024	Bank of America	USD	20 210	1 706	(18 504)
696 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 19,23 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	30 176	50	(30 126)
26	Call auf International Business Machines Corp. Ausübungskurs 220,00 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5 099	12 350	7 251
21	Call auf McDonald's Corp. Ausübungskurs 305,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4 364	9 923	5 559

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt-wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
10	Call auf Microsoft Corp. Ausübungskurs 450,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4 127	1 435	(2 692)
2	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 19 900,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	58 211	85 040	26 829
2	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 20 225,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	43 167	48 070	4 903
1	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 20 550,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	8 041	7 175	(866)
21	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 130,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4 795	3 801	(994)
105	Call auf PENN Entertainment, Inc. Ausübungskurs 21,00 Verfallstermin 01. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	7 196	7 560	364
98	Put auf Philadelphia Stock Exchange Ausübungskurs 5 684,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3 749	2 112	(1 637)
303	Call auf Pinterest, Inc. Ausübungskurs 35,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	17 298	11 514	(5 784)
5	Call auf RH Ausübungskurs 340,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	6 011	2 250	(3 761)
(5)	Call auf RH Ausübungskurs 380,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 354)	(113)	1 241
6	Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2 260,00 Verfallstermin 30. Sep. 2024	Morgan Stanley	USD	14 524	24	(14 500)
4	Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2 270,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	10 685	10 120	(565)
10	Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2 275,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	17 608	18 050	442
16	Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2 300,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	24 917	25 680	763
6	Call auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5 800,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	23 836	21 060	(2 776)
684	Call auf S&P Regional Banks Select Industry Index Ausübungskurs 1 823,00 Verfallstermin 18. Sep. 2024	Morgan Stanley	USD	17 036	13 765	(3 271)
16	Call auf Shopify, Inc. Ausübungskurs 86,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	1 197	1 232	35
15	Call auf Snowflake, Inc. Ausübungskurs 120,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	6 441	8 513	2 072
(15)	Call auf Snowflake, Inc. Ausübungskurs 140,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 154)	(1 830)	(676)
110	Call auf SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF Ausübungskurs 5 264,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9 307	2 960	(6 347)
21	Call auf Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 185,00 Verfallstermin 01. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	9 996	9 765	(231)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(21)	Call auf Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 205,00 Verfallstermin 01. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(2 213)	(2 237)	(24)
108	Call auf Tencent Music Entertainment Group Ausübungskurs 13,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	9 111	7 020	(2 091)
15	Call auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 255,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 060	17 288	10 228
8 055	Call auf Ubisoft Entertainment S.A. Ausübungskurs 32,00 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Goldman Sachs	EUR	18 592	248	(18 344)
(46)	Call auf Verizon Communications, Inc. Ausübungskurs 47,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 388)	(1 932)	(544)
51	Call auf Walmart, Inc. Ausübungskurs 86,67 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	5 672	7 599	1 927
41	Call auf Walt Disney Co. Ausübungskurs 100,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	8 583	12 710	4 127
(41)	Call auf Walt Disney Co. Ausübungskurs 110,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(2 427)	(3 567)	(1 140)
311	Call auf Warner Bros. Discovery, Inc. Ausübungskurs 9,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	11 917	3 266	(8 651)
36	Call auf Wayfair, Inc. Ausübungskurs 60,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	6 611	5 634	(977)
82	Call auf Yum China Holdings, Inc. Ausübungskurs 50,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	6 217	4 715	(1 502)
(5)	Put auf Adobe, Inc. Ausübungskurs 460,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 647)	(1 493)	154
36	Put auf Airbnb, Inc. Ausübungskurs 115,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	8 283	10 404	2 121
36	Put auf Airbnb, Inc. Ausübungskurs 95,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	4 905	2 844	(2 061)
20	Put auf Alphabet, Inc. Ausübungskurs 155,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	2 758	1 030	(1 728)
36	Put auf Amazon.com, Inc. Ausübungskurs 177,50 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4 979	4 896	(83)
(319)	Put auf Antero Resources Corp. Ausübungskurs 20,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(62 765)	(44 022)	18 743
20	Put auf Apple, Inc. Ausübungskurs 210,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 321	760	(6 561)
26	Put auf Apple, Inc. Ausübungskurs 215,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	1 579	221	(1 358)
52	Put auf CBOE Mini-SPX Index Ausübungskurs 560,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 526	2 548	(4 978)
(58)	Put auf Chesapeake Energy Corp. Ausübungskurs 60,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(29 969)	(19 865)	10 104
(57)	Put auf Chesapeake Energy Corp. Ausübungskurs 60,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	(9 670)	(3 306)	6 364

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
102	Put auf Clear Secure, Inc. Ausübungskurs 31,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9 419	3 825	(5 594)
(21)	Put auf Coherent Corp. Ausübungskurs 65,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 495)	(1 575)	(80)
21	Put auf Coherent Corp. Ausübungskurs 80,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	6 811	7 350	539
(5)	Put auf Costco Wholesale Corp. Ausübungskurs 830,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 531)	(510)	1 021
5	Put auf Costco Wholesale Corp. Ausübungskurs 860,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3 513	2 025	(1 488)
(175)	Put auf Coterra Energy, Inc. Ausübungskurs 20,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(27 594)	(23 625)	3 969
41	Put auf Crown Castle, Inc. Ausübungskurs 110,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 207	2 153	(5 054)
25	Put auf Dell Technologies, Inc. Ausübungskurs 100,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	7 677	3 462	(4 215)
(25)	Put auf Dell Technologies, Inc. Ausübungskurs 85,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 868)	(713)	1 155
20	Put auf Dell Technologies, Inc. Ausübungskurs 95,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4 206	350	(3 856)
194	Put auf Devon Energy Corp. Ausübungskurs 32,50 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	51 278	56 551	5 273
22	Put auf Diamondback Energy, Inc. Ausübungskurs 145,31 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	23 445	25 410	1 965
64	Put auf Doximity, Inc. Ausübungskurs 40,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5 404	1 120	(4 284)
(245)	Put auf EQT Corp. Ausübungskurs 25,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(46 258)	(33 810)	12 448
(258)	Put auf EQT Corp. Ausübungskurs 28,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	(35 522)	(8 643)	26 879
185 000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,62 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Bank of America	EUR	1 867	2 345	478
184 000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 670	2 666	996
269 000	Put auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 393,74 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 932	–	(1 932)
(269 000)	Put auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,16 Verfallstermin 01. Okt. 2024	HSBC	EUR	(6 837)	(3 496)	3 341
(277 000)	Put auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,82 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Morgan Stanley	EUR	(3 075)	(3 155)	(80)
(277 000)	Put auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,83 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	(3 011)	(2 975)	36
185 000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,78 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 762	3 951	2 189

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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.)						
184 000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,80 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Barclays Bank	EUR	1 855	5 510	3 655
860 000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,20 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Barclays Bank	EUR	4 901	11	(4 890)
277 000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,29 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1 645	778	(867)
277 000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,29 Verfallstermin 15. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1 603	940	(663)
181 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Bank of America	EUR	2 495	516	(1 979)
185 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 09. Okt. 2024	UBS	EUR	1 320	411	(909)
184 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1 381	1 110	(271)
185 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,12 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	EUR	2 537	2 597	60
155 000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,93 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 685	1 773	88
155 000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 591	558	(1 033)
156 000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 187,08 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	2 707	235	(2 472)
157 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 01. Nov. 2024	BNP Paribas	GBP	2 585	73	(2 512)
155 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 629	2	(1 627)
155 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1 567	389	(1 178)
335 000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	NZD	3 340	52	(3 288)
(495 000)	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 09. Okt. 2024	HSBC	NZD	(3 550)	(107)	3 443
330 000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,62 Verfallstermin 23. Okt. 2024	HSBC	NZD	2 227	819	(1 408)
(448 000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,32 Verfallstermin 30. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	(6 129)	(5 582)	547
207 000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,49 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	5 637	5 262	(375)
450 000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,65 Verfallstermin 02. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	14 648	19 802	5 154
(1 341 000)	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Bank of America	USD	(6 866)	(8 134)	(1 268)
206 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 20. Dez. 2024	UBS	USD	2 014	1 800	(214)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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.)						
1 341 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Bank of America	USD	18 302	20 815	2 513
207 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1 124	1 082	(42)
206 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1 004	1 426	422
199 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Verfallstermin 07. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	2 123	3 396	1 273
1 732 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Barclays Bank	USD	24 560	35 406	10 846
206 000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,84 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	3 062	3 391	329
199 000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,85 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	3 190	2 139	(1 051)
(2 034 000)	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,88 Verfallstermin 08. Nov. 2024	Bank of America	USD	(17 505)	(79 325)	(61 820)
308 000	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 946,65 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4 472	16 261	11 789
(1 356 000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,81 Verfallstermin 09. Mai 2025	Morgan Stanley	USD	(11 662)	(16 974)	(5 312)
(1 356 000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,82 Verfallstermin 05. Mrz. 2025	J.P. Morgan	USD	(11 450)	(12 424)	(974)
(1 356 000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,84 Verfallstermin 18. Feb. 2025	BNP Paribas	USD	(13 126)	(12 565)	561
(1 356 000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,91 Verfallstermin 22. Apr. 2025	BNP Paribas	USD	(14 902)	(24 358)	(9 456)
(311 000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,97 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	(2 091)	(2 016)	75
(309 000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,11 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1 794)	(4 654)	(2 860)
299 000	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4 186,00 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4 899	321	(4 578)
307 000	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4 226,00 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4 884	3 331	(1 553)
207 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,03 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	1 000	847	(153)
1 732 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,63 Verfallstermin 14. Feb. 2025	Goldman Sachs	USD	13 960	13 446	(514)
(207 000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,30 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	(4 624)	(4 017)	607
202 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 155,70 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Bank of America	USD	3 563	17 211	13 648
(479 000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,28 Verfallstermin 04. Dez. 2024	UBS	USD	(17 163)	(1 163)	16 000

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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.)						
(460 000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,87 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(16 431)	(3 621)	12 810
(866 000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,42 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Deutsche Bank	USD	(34 970)	(17 129)	17 841
309 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,49 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	5 250	2 912	(2 338)
309 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,17 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Deutsche Bank	USD	5 698	8 348	2 650
880 000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 3,94 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	22 097	27 615	5 518
(207 000)	Put auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,06 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(4 022)	(3 416)	606
312 000	Put auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,12 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	3 211	2 766	(445)
(307 000)	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,30 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1 827)	(4 500)	(2 673)
(312 000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 32,60 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	(3 253)	(4 353)	(1 100)
(299 000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 33,92 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2 989)	(13 892)	(10 903)
(1 056 000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 35,65 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Bank of America	USD	(21 616)	(113 620)	(92 004)
(1 391 000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 36,36 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	(28 514)	(170 661)	(142 147)
311 000	Put auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 31,36 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	2 879	1 982	(897)
(309 000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 17,37 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Bank of America	USD	(4 257)	(4 325)	(68)
460 000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,20 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	16 774	25 480	8 706
479 000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,84 Verfallstermin 04. Dez. 2024	Bank of America	USD	17 804	41 751	23 947
696 000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 19,23 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	26 467	77 127	50 660
20	Put auf Global Payments, Inc. Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3 720	8 200	4 480
(26)	Call auf Marvell Technology, Inc. Ausübungskurs 57,50 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 409)	(1 391)	18
26	Call auf Marvell Technology, Inc. Ausübungskurs 67,50 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	7 236	6 422	(814)
(16)	Put auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 500,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2 191)	(1 336)	855
16	Put auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 540,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9 427	5 760	(3 667)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
15	Put auf Micron Technology, Inc. Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	2 779	6 900	4 121
(21)	Put auf Micron Technology, Inc. Ausübungskurs 76,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 755)	(21)	1 734
21	Put auf Micron Technology, Inc. Ausübungskurs 86,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 509	31	(7 478)
(3)	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 17 300,00 Verfallstermin 30. Sep. 2024	Morgan Stanley	USD	(17 126)	(150)	16 976
3	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 18 075,00 Verfallstermin 30. Sep. 2024	Morgan Stanley	USD	37 837	278	(37 559)
2	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 19 725,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	31 935	35 990	4 055
31	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 109,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 780	4 325	(3 455)
(31)	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 95,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 520)	(915)	605
103	Put auf Ovintiv Inc. Ausübungskurs 33,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	37 177	36 565	(612)
238	Put auf Philadelphia Stock Exchange Ausübungskurs 4 200,00 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	UBS	USD	38 009	31 849	(6 160)
118	Put auf Philadelphia Stock Exchange Ausübungskurs 4 600,00 Verfallstermin 20. Dez. 2024	UBS	USD	19 647	15 592	(4 055)
128	Put auf Philadelphia Stock Exchange Ausübungskurs 5 050,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	11 648	13 267	1 619
15	Put auf Qualcomm, Inc. Ausübungskurs 160,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5 385	2 805	(2 580)
182 872	Put auf S&P 500 Index vs SOFR Ausübungskurs 5 185,42 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Goldman Sachs	USD	11 155	5 451	(5 704)
222 989	Put auf S&P 500 Index vs SOFR Ausübungskurs 5 185,42 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Goldman Sachs	USD	14 829	9 508	(5 321)
222 989	Put auf S&P 500 Index vs SOFR Ausübungskurs 5 185,42 Verfallstermin 20. Jun. 2025	Goldman Sachs	USD	16 724	13 202	(3 522)
10	Put auf Spotify Technology S.A. Ausübungskurs 360,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5 096	6 250	1 154
218	Put auf Suncor Energy, Inc. Ausübungskurs 30,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	46 048	41 093	(4 955)
30	Call auf Target Corp. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 817	3 720	(4 097)
(5)	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 190,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(630)	(413)	217
5	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 230,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3 827	2 700	(1 127)
57	Put auf Uber Technologies, Inc. Ausübungskurs 65,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7 646	1 283	(6 363)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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.)						
(88)	Put auf Verizon Communications, Inc. Ausübungskurs 39,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1 798)	(1 408)	390
88	Put auf Verizon Communications, Inc. Ausübungskurs 43,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	8 520	6 732	(1 788)
26	Put auf Vertiv Holdings Co. Ausübungskurs 98,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9 914	9 360	(554)
				USD	520 956	(360 049)

Swaptions

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

Zum 30. September 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	CDX „iTraxx Europe Crossover Series 41 20/06/2029“, Put, Ausübungskurs 325,00, 18. Dez. 2024	Morgan Stanley	EUR	88 208	7 295 000	42 851	(45 357)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 6,80% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb. 2025“, Call; 6,80%; 07. Feb. 2025	J.P. Morgan	MXN	541 676	228 495 000	27 814	(513 862)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,29% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2026“, Call, 7,29%, 05 Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396 524	157 510 000	113 524	(283 000)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 9,92% Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mai 2025“, Call, 9,92%, 02. Mai 2025	J.P. Morgan	ZAR	69 362	49 657 000	274 327	204 965
Kauf	SWP „Zahlt Festzinssatz 9,37% Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Jun 2029“, Call 9,37%, 14. Jun. 2029	J.P. Morgan	MXN	499 060	157 510 000	211 482	(287 578)
Kauf	SWP „Zahlt Festzinssatz 9,74% Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Put; 9,74%; 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	76 455	17 150 000	28 509	(47 946)
Kauf	SWP „Erhält Festzinssatz 7,33% Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mrz. 2025“, Call, 7,33%, 04. Mrz. 2025	Goldman Sachs	ZAR	43 607	70 032 000	36 731	(6 876)
Kauf	SWP „Erhält Festzinssatz 8,05% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr. 2028“, Call, 8,05%, 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	73 126	17 150 000	20 607	(52 519)
Kauf	SWP „Erhält Festzinssatz 8,50% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Aug. 2025“, Call, 8,50%, 06. Aug. 2025	J.P. Morgan	MXN	107 321	210 972 000	108 793	1 472
Verkauf	CDX „iTraxx Europe Crossover Series 41 20/06/2029“, Put, Ausübungskurs 400,00, 18. Dez. 2024	Morgan Stanley	EUR	(37 861)	(7 295 000)	(18 010)	19 851

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Swaptions (Forts.)

Schutz- positiona	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,92% Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mai 2025“, Call, 8,92%, 02. Mai 2025	J.P. Morgan	ZAR	(14 672)	(49 657 000)	(117 448)	(102 776)
					USD	729 180	(1 113 626)

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 Gesamtrendite der Referenzanlagen (Coupons und/oder Kapitalgewinne und/oder -verluste) zu erhalten. Bei der Referenzanlage kann es sich um fast jede beliebige Anlage handeln, die eine für die Teilfonds zulässige Anlage darstellt. Die Teilfonds können solche Instrumente für die Aufnahme von Positionen in einem qualifizierten Markt oder zu Absicherungszwecken einsetzen.

Die Total Return Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus Total Return Swaps zum Ende des Geschäftsjahres ist durch 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 30. September 2024 waren folgende Teilfonds in Total Return Swapkontrakten engagiert:

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	GBP	19 792 213	22. Sep. 2025	5 609 652
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	17 791 213	28. Feb. 2025	(613 858)
Kauf Long	Banken	Merrill Lynch	EUR	12 493 047	30. Apr. 2025	(507 308)
Kauf Long	Banken	Merrill Lynch	EUR	8 095 415	30. Mai 2025	272 377
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	GBP	8 286 124	28. Feb. 2025	139 331
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	GBP	3 769 513	30. Apr. 2025	291 416
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	504 714	21. Jul. 2027	58 457
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	4 820 773	28. Feb. 2025	(66 014)
Kauf Long	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	3 370 917	30. Jun. 2027	702 740
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	5 806 537	09. Aug. 2027	(423 381)
Verkauf Short	Werbung	Merrill Lynch	USD	1 203 492	31. Okt. 2025	(52 051)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	JPY	1 241 128	28. Feb. 2025	(47 551)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	GBP	1 226 437	02. Sep. 2027	80 141
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	2 444 025	21. Apr. 2025	347 495
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	2 002 245	31. Jul. 2025	(564 634)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	2 243 559	18. Okt. 2024	123 278
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	1 017 516	03. Nov. 2025	4 011
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	USD	2 922 280	03. Jul. 2025	(136 708)
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	USD	1 255 553	20. Okt. 2025	50 856
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	443 951	28. Apr. 2026	(187 539)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1 464 386	23. Okt. 2025	(23 916)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	1 740 959	20. Jan. 2027	(165 815)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	1 753 134	12. Aug. 2026	366 081
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	JPY	1 446 497	28. Feb. 2025	(16 397)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	1 509 584	27. Sep. 2027	13 685
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	2 469 094	28. Feb. 2025	(340 749)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Merrill Lynch	USD	1 496 344	31. Okt. 2025	118 959
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Morgan Stanley	USD	818 008	10. Okt. 2024	(205 779)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	706 242	19. Aug. 2025	90 777
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	960 860	31. Jul. 2025	(89 123)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	743 975	28. Feb. 2025	(33 571)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Energie – Alternative Energiequellen	Merrill Lynch	USD	1 916 214	31. Jul. 2025	(159 343)
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	SEK	974 273	07. Sep. 2027	42 112
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1 303 485	13. Jan. 2027	181 808
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	1 731 603	28. Feb. 2025	56 140
Verkauf Short	Gastronomie	Morgan Stanley	EUR	960 767	28. Feb. 2025	151 722
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	771 204	28. Apr. 2026	93 402
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	1 422 993	28. Feb. 2025	(42 500)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	2 386 219	31. Jul. 2025	(438 855)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	2 105 204	08. Sep. 2025	(236 429)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1 232 070	31. Okt. 2025	3 849
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1 987 134	28. Feb. 2025	(69 729)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Goldman Sachs	EUR	133 827	14. Jul. 2027	2 941
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	12 284	28. Sep. 2027	181
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	EUR	1 026 470	15. Sep. 2027	(130 596)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	1 272 391	31. Okt. 2025	15 855
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1 955 298	10. Okt. 2024	(55 370)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	DKK	1 188 793	28. Jul. 2027	(53 334)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1 368 445	10. Dez. 2026	(271 401)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1 889 440	28. Jun. 2027	(186 849)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	CAD	1 159 478	23. Dez. 2024	(124 294)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	GBP	964 508	29. Aug. 2025	47 650
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	8 618 489	31. Jul. 2025	1 379 352
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	2 163 341	02. Sep. 2025	(156 564)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	1 602 129	21. Okt. 2024	(308 828)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	2 089 545	08. Sep. 2025	(169 056)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	1 180 378	10. Aug. 2027	(18 007)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1 706 532	21. Jul. 2025	184 028
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	950 158	20. Okt. 2025	4 130
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1 260 618	31. Okt. 2025	(2 747)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	1 443 647	28. Feb. 2025	(122 734)
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	1 146 305	02. Sep. 2025	(78 873)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	EUR	3 726 996	28. Feb. 2025	(151 665)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	USD	31 724 778	28. Feb. 2025	(1 816 435)
EUR						2 364 423
Schroder GAIA Helix						
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	327 028	13. Dez. 2024	(33)
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	8 990 589	18. Sep. 2025	(1 325 068)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	14 490 945	18. Sep. 2025	(1 915 144)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	12 122 568	18. Sep. 2025	(4 688 734)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	299 688	13. Dez. 2024	(30)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	10 069 507	18. Sep. 2025	(15 209 959)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	1 771 088	18. Sep. 2025	(51 903)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	9 198 067	18. Sep. 2025	0
USD						(23 190 871)
Schroder GAIA Sirios US Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	2 981 598	12. Jun. 2025	(13 396)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	5 011 181	24. Jun. 2025	(358 671)
Kauf Long	Getränke	Merrill Lynch	USD	2 651 350	24. Dez. 2024	175 614
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	12 408 238	24. Jun. 2025	461 797

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)						
Kauf Long	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	192 940	24. Jul. 2025	16 471
Kauf Long	Private Equity	Merrill Lynch	USD	3 158 022	24. Apr. 2025	132 943
Kauf Long	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	8 557 097	24. Okt. 2025	(368 969)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	3 148 587	28. Okt. 2025	12 549
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Barclays Bank	USD	4 143 439	12. Nov. 2024	108 378
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	798 471	09. Apr. 2025	(7 298)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	1 256 841	07. Okt. 2024	(59 588)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	751 308	10. Feb. 2025	61 503
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	548 549	16. Okt. 2025	4 164
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Merrill Lynch	USD	306 940	28. Jul. 2025	(64 047)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	294 753	30. Apr. 2025	(54 338)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	882 124	03. Feb. 2025	16 300
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1 048 055	24. Jun. 2025	(20 794)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	822 059	22. Sep. 2025	16 010
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	174 442	24. Feb. 2025	(7 816)
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	80 076	02. Jun. 2025	8 938
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	115 836	14. Jul. 2025	(11 981)
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	203 160	01. Aug. 2025	6 412
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	508 443	17. Okt. 2025	39 626
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1 706 905	28. Okt. 2024	4 337
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	805 743	30. Sep. 2025	16 500
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	577 993	09. Okt. 2025	(31 024)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	947 772	11. Okt. 2024	(25 706)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	409 557	18. Nov. 2024	(9 549)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	208 526	11. Feb. 2025	7 800
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	718 238	24. Jun. 2025	(4 395)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	439 082	14. Jul. 2025	(21 236)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	284 721	02. Sep. 2025	10 960
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	559 135	08. Sep. 2025	145 233
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	169 384	12. Aug. 2025	(1 429)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	USD	118 685	12. Sep. 2025	(11 440)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Merrill Lynch	USD	204 467	10. Okt. 2025	(636)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 057 584	12. Mrz. 2025	(94 990)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	680 265	11. Dez. 2025	(27 889)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	143 728	28. Apr. 2025	4 089
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1 138 592	26. Sep. 2025	(57 601)
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Goldman Sachs	USD	206 473	23. Apr. 2025	(16 355)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	817 203	03. Feb. 2025	(91 755)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	912 617	30. Mai 2025	11 777
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	537 224	17. Jul. 2025	50 898
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	453 096	28. Jul. 2025	(34 412)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	847 479	24. Okt. 2025	(16 497)
Verkauf Short	Unterhaltung	Merrill Lynch	USD	463 601	10. Jul. 2025	(8 294)
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	573 076	12. Jun. 2025	(407 865)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1 533 620	12. Dez. 2024	(171 430)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3 440 631	12. Jun. 2025	(305 135)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	10 234 539	20. Okt. 2025	(387 744)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	5 024 380	11. Dez. 2025	(164 318)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	12 113 692	25. Jun. 2025	(619 168)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	3 809 882	26. Jun. 2025	4 767

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	936 394	21. Jan. 2025	(29 013)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	126 276	24. Okt. 2025	(3 460)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	738 424	24. Dez. 2024	(67 948)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1 121 772	24. Jun. 2025	(26 638)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	513 838	12. Sep. 2025	(93 227)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	112 881	15. Jan. 2025	716
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	116 999	26. Mrz. 2025	4 493
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	531 998	24. Jun. 2025	31 002
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	906 121	24. Okt. 2025	23 873
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 183 199	12. Dez. 2024	(61 241)
Verkauf Short	Internet	Barclays Bank	USD	2 004 276	12. Nov. 2024	7 795
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	1 478 209	16. Jan. 2025	(84 604)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	497 392	28. Apr. 2025	(24 546)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	368 803	22. Sep. 2025	6 675
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	766 047	09. Apr. 2025	(169 350)
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	1 178 420	05. Mai 2025	97 613
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	533 232	24. Jun. 2025	(20 137)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	659 537	25. Nov. 2024	(47 852)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	313 982	28. Jan. 2025	28 257
Verkauf Short	Immobilien	Merrill Lynch	USD	632 105	29. Sep. 2025	40 377
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	845 755	24. Dez. 2024	(22 592)
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1 004 220	24. Apr. 2025	(51 345)
Verkauf Short	Einzelhandel	Barclays Bank	USD	2 062 830	12. Nov. 2024	5 489
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	60 605	25. Nov. 2024	54 208
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	159 720	12. Aug. 2025	12 982
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	126 066	24. Okt. 2025	(1 035)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	79 002	14. Nov. 2024	(3 473)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	143 529	25. Nov. 2024	17 668
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	466 249	09. Jun. 2025	9 759
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1 142 010	29. Sep. 2025	(123 446)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	367 347	15. Sep. 2025	(28 838)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	373 883	14. Okt. 2025	(36 737)
Verkauf Short	Telekommunikation	Merrill Lynch	USD	283 287	30. Sep. 2025	(114 874)
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	240 325	05. Nov. 2024	(16 956)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	263 911	26. Jun. 2025	1 905
USD						(2 843 200)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified						
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	316 176 916	18. Okt. 2024	(5 568 297)
USD						(5 568 297)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
Kauf Long	Werbung	J.P. Morgan	EUR	432 652	05. Mai 2028	9 740
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	403 373	24. Mai 2033	(10 375)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	1 453 440	05. Mai 2028	(61 886)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	GBP	427 388	05. Mai 2028	(21 635)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	43 566	18. Mai 2033	(1 719)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	41 059	24. Mai 2033	3 542
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	DKK	343 287	05. Mai 2028	(9 121)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	1 332 398	05. Mai 2028	(58 600)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	14 334	18. Mai 2033	(1 204)
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	USD	236 962	05. Mai 2028	61 176
Kauf Long	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	USD	177 462	17. Mai 2033	(808)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	979 926	24. Mai 2033	(9 110)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	HUF	245 853	24. Mai 2033	920
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	107 870	24. Mai 2033	(2 558)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	2 862 625	23. Mai 2033	(1 390)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	AUD	248 677	05. Mai 2028	14 448
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	3 760 040	05. Mai 2028	13 078
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	510 919	08. Mai 2028	(13 323)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	2 195 849	05. Mai 2028	92 164
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	2 726 139	18. Mai 2033	70 552
Kauf Long	Getränke	J.P. Morgan	DKK	284 878	05. Mai 2028	(5 232)
Kauf Long	Getränke	J.P. Morgan	EUR	271 585	05. Mai 2028	(8 914)
Kauf Long	Getränke	Morgan Stanley	USD	220 037	18. Mai 2033	(18 549)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	13 312	24. Mai 2033	(738)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	567 209	23. Mai 2033	(17 233)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	755 354	24. Mai 2033	6 976
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	90 627	05. Mai 2028	(9 254)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	121 831	18. Mai 2033	(10 750)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	2 496 148	18. Mai 2033	(119 345)
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	EUR	127 556	24. Mai 2033	(1 524)
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	49 022	23. Mai 2033	306
Kauf Long	Baustoffe	J.P. Morgan	CHF	617 073	05. Mai 2028	23 150
Kauf Long	Baustoffe	J.P. Morgan	EUR	492 125	05. Mai 2028	26 762
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	75 249	18. Mai 2033	4 499
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	EUR	41 064	24. Mai 2033	3 673
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	EUR	496 340	05. Mai 2028	33 151
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	155 538	24. Mai 2033	(5 523)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	643 562	23. Mai 2033	(2 693)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	128 299	24. Mai 2033	(1 727)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	578 622	05. Mai 2028	(91 775)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	25 333	05. Mai 2028	(19)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 114 491	18. Mai 2033	(22 595)
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	574 608	24. Mai 2033	12 086
Kauf Long	Computer	J.P. Morgan	GBP	350 412	05. Mai 2028	10 696
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	382 021	18. Mai 2033	29 457
Kauf Long	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	GBP	32 251	24. Mai 2033	55
Kauf Long	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	GBP	983 911	05. Mai 2028	(12 738)
Kauf Long	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	EUR	21 211	24. Mai 2033	1 475
Kauf Long	Vertrieb/Grosshandel	J.P. Morgan	GBP	969 282	05. Mai 2028	18 173
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	4 586 895	23. Mai 2033	11 189
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	660 526	05. Mai 2028	(4 497)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	96 926	05. Mai 2028	1 829
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 260 796	18. Mai 2033	40 421
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	177 428	05. Mai 2028	(7 149)
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	CAD	81 180	17. Mai 2033	517
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	322 747	24. Mai 2033	4 901
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	CHF	270 972	05. Mai 2028	15 540

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Elektronik	J.P. Morgan	GBP	439 229	05. Mai 2028	(14 445)
Kauf Long	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	335 157	05. Mai 2028	(27 545)
Kauf Long	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	36 680	18. Mai 2033	503
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	1 277 409	05. Mai 2028	6 783
Kauf Long	Unterhaltung	Goldman Sachs	EUR	19 541	24. Mai 2033	630
Kauf Long	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	337 165	23. Mai 2033	3 914
Kauf Long	Unterhaltung	J.P. Morgan	EUR	67 264	05. Mai 2028	(2 623)
Kauf Long	Unterhaltung	J.P. Morgan	GBP	197 735	05. Mai 2028	16 276
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	200 327	18. Mai 2033	(6 409)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	68 313	18. Mai 2033	(1 847)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	2 905 896	18. Mai 2033	118 761
Kauf Long	Umweltschutz	J.P. Morgan	EUR	329 673	05. Mai 2028	33 402
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	501 145	24. Mai 2033	6 134
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	125 473	05. Mai 2028	607
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	460 126	18. Mai 2033	35 321
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	502 769	18. Mai 2033	(957)
Kauf Long	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	328 155	05. Mai 2028	28 757
Kauf Long	Gastronomie	J.P. Morgan	GBP	213 599	05. Mai 2028	(3 122)
Kauf Long	Gas	J.P. Morgan	USD	229 119	05. Mai 2028	12 123
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	HKD	33 660	18. Mai 2033	6 458
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	USD	41 112	18. Mai 2033	340
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	623 609	23. Mai 2033	1 391
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	724 041	24. Mai 2033	(737)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	EUR	544 371	05. Mai 2028	2 978
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1 176 312	05. Mai 2028	29 072
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	1 998 784	18. Mai 2033	(10 733)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	178 270	23. Mai 2033	(6 929)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	175 975	24. Mai 2033	370
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	571 492	05. Mai 2028	(5 254)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	629 995	18. Mai 2033	(1 684)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	279 544	24. Mai 2033	6 144
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	J.P. Morgan	GBP	535 901	05. Mai 2028	(46 316)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	507 120	08. Mai 2028	12 887
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	317 375	18. Mai 2033	26 512
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	CHF	276 624	24. Mai 2033	1 498
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	264 521	24. Mai 2033	3 305
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	GBP	239 529	24. Mai 2033	25 862
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	HKD	246 903	24. Mai 2033	48 393
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	NOK	21 334	24. Mai 2033	(127)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	69 162	05. Mai 2028	4 202
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	897 467	05. Mai 2028	(13 048)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	783 188	05. Mai 2028	(15 310)
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	122 543	18. Mai 2033	(234)
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	USD	84 693	18. Mai 2033	(10 507)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	EUR	41 561	24. Mai 2033	(1 159)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	733 543	23. Mai 2033	2 275
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	278 257	24. Mai 2033	3 691
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	EUR	815 864	05. Mai 2028	79 386
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	GBP	39 521	05. Mai 2028	2 160

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	J.P. Morgan	HKD	135 832	05. Mai 2028	51 536
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	1 451 049	05. Mai 2028	65 082
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	EUR	10 208	18. Mai 2033	(243)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	264 102	18. Mai 2033	90 406
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	5 572 191	18. Mai 2033	244 486
Kauf Long	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	USD	147 703	18. Mai 2033	(1 274)
Kauf Long	Freizeit	Goldman Sachs	USD	240 015	23. Mai 2033	4 565
Kauf Long	Freizeit	Morgan Stanley	USD	472 217	18. Mai 2033	21 199
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	EUR	159 829	24. Mai 2033	(1 582)
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	USD	406 945	23. Mai 2033	(5 441)
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	HKD	134 944	18. Mai 2033	6 201
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	1 087 001	18. Mai 2033	142 694
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	Goldman Sachs	USD	3 876	23. Mai 2033	203
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	USD	215 380	05. Mai 2028	69 758
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	Morgan Stanley	USD	53 803	18. Mai 2033	4 217
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	GBP	579 533	05. Mai 2028	18 499
Kauf Long	Medien	Goldman Sachs	USD	469	23. Mai 2033	12
Kauf Long	Medien	Goldman Sachs	USD	561 832	24. Mai 2033	(2 168)
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	256 911	18. Mai 2033	829
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	133 026	24. Mai 2033	12 514
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	342 749	05. Mai 2028	44 313
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	CHF	7 643	05. Mai 2028	735
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	GBP	614 713	05. Mai 2028	(24 456)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	SEK	332 596	05. Mai 2028	7 920
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	257 628	05. Mai 2028	32 481
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	CHF	45 520	18. Mai 2033	3 854
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	GBP	61 206	18. Mai 2033	(1 207)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	419 004	05. Mai 2028	19 053
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	534 915	18. Mai 2033	17 841
Kauf Long	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	19 682	18. Mai 2033	(259)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	46 818	24. Mai 2033	(3 483)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	232 012	24. Mai 2033	(998)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	439 483	24. Mai 2033	(6 002)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	665 838	24. Mai 2033	(36 028)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	406 419	23. Mai 2033	1 680
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	321 854	24. Mai 2033	(6 075)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	28 544	05. Mai 2028	(505)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	DKK	56 802	05. Mai 2028	(1 357)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	470 508	05. Mai 2028	7 082
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	6 692	08. Mai 2028	(1 155)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	504 050	05. Mai 2028	8 872
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	850 958	18. Mai 2033	(121 780)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	71 681	18. Mai 2033	(3 693)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2 081 210	18. Mai 2033	(76 306)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	601 317	05. Mai 2028	13 426
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	469 844	18. Mai 2033	(8 591)
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	289 642	24. Mai 2033	(5 761)
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	667 703	18. Mai 2033	17 711
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	USD	200 530	18. Mai 2033	(1 112)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	REITS	Goldman Sachs	USD	438 152	23. Mai 2033	(4 660)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	33 250	05. Mai 2028	1 390
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	646 712	18. Mai 2033	(9 912)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	200 244	24. Mai 2033	5 622
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	34 766	24. Mai 2033	3 016
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	GBP	15 476	24. Mai 2033	642
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1 962 026	23. Mai 2033	(10 493)
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	DKK	424 187	05. Mai 2028	(20 196)
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	EUR	497 196	05. Mai 2028	60 386
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	GBP	306 878	05. Mai 2028	15 615
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	17 721	18. Mai 2033	(128)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	3 211 959	18. Mai 2033	(2 867)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	262 975	24. Mai 2033	6 075
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	147 379	24. Mai 2033	(2 748)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	EUR	579 658	05. Mai 2028	(7 322)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	512 180	08. Mai 2028	(26 144)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	216 955	05. Mai 2028	16 560
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	2 617 192	18. Mai 2033	83 412
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	EUR	43 440	24. Mai 2033	(7 551)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	285 251	23. Mai 2033	(7 348)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	313 057	05. Mai 2028	(9 401)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	1 843 246	18. Mai 2033	12 037
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	281 179	08. Mai 2028	20 616
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	193 736	05. Mai 2028	12 752
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	SGD	355 119	18. Mai 2033	(5 441)
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	876 064	18. Mai 2033	19 085
Kauf Long	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Morgan Stanley	USD	326 827	18. Mai 2033	11 848
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	10 787 183	25. Mai 2033	(51 961)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	132 785	23. Mai 2033	(1 415)
Verkauf Short	Werbung	J.P. Morgan	EUR	347 318	05. Mai 2028	(7 819)
Verkauf Short	Werbung	J.P. Morgan	USD	198 985	05. Mai 2028	(1 075)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	USD	403 948	18. Mai 2033	(7 550)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	267 947	24. Mai 2033	(438)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	20 950	05. Mai 2028	83
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	EUR	182 505	24. Mai 2033	(9 046)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	46 123	24. Mai 2033	(2 668)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	13 903	05. Mai 2028	(64)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	PLN	145 894	05. Mai 2028	(10 046)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	83 571	18. Mai 2033	776
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	157 607	17. Mai 2033	(2 290)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	402 421	18. Mai 2033	(8 163)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	137 536	24. Mai 2033	470
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	SEK	41 307	24. Mai 2033	(1 061)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	14 533	23. Mai 2033	(1 426)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	256 211	05. Mai 2028	(6 664)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	SEK	233 586	05. Mai 2028	(10 623)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	SEK	14 882	18. Mai 2033	3
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	199 113	18. Mai 2033	(30 598)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	EUR	52 717	24. Mai 2033	(7 350)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	56 571	18. Mai 2033	(2 058)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	393 505	24. Mai 2033	(8 247)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CZK	220 042	24. Mai 2033	(6 793)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	1 228 039	24. Mai 2033	13 678
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	831 626	24. Mai 2033	(10 970)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	575 426	24. Mai 2033	11 129
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	4 208 238	23. Mai 2033	(27 350)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	2 649 666	24. Mai 2033	21 469
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	288 464	05. Mai 2028	15 523
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CHF	117 273	05. Mai 2028	(367)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	2 339 179	05. Mai 2028	(35 729)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	1 208 245	05. Mai 2028	(16 922)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	PLN	375 980	05. Mai 2028	21 256
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	651 385	05. Mai 2028	2 545
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	1 494 937	05. Mai 2028	(42 636)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	504 093	18. Mai 2033	7 740
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	289 882	18. Mai 2033	(10 024)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CHF	339 203	18. Mai 2033	6 850
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CZK	109 748	18. Mai 2033	(4 123)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	DKK	385 928	18. Mai 2033	(3 098)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	586 730	18. Mai 2033	7 136
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	1 225 829	18. Mai 2033	(30 671)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	811 356	18. Mai 2033	8 043
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	4 749 848	18. Mai 2033	(66 325)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	USD	13 181	24. Mai 2033	87
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	USD	1 078 229	18. Mai 2033	13 546
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	262 397	24. Mai 2033	2 026
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	118 805	05. Mai 2028	(1 849)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1 288 778	18. Mai 2033	7 070
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	123 558	24. Mai 2033	(1 863)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	15 736	24. Mai 2033	(2 270)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	CHF	48 275	05. Mai 2028	(445)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	SEK	124 086	05. Mai 2028	(21 345)
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	SEK	182 928	18. Mai 2033	(31 066)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	3 081	24. Mai 2033	(42)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	948 278	23. Mai 2033	7 808
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	548 578	24. Mai 2033	22 258
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	60 635	05. Mai 2028	(6 426)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	289 841	05. Mai 2028	4 360
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 764 164	18. Mai 2033	31 004
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	36 706	24. Mai 2033	(1 082)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	EUR	59 245	24. Mai 2033	(712)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	41 431	23. Mai 2033	(570)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	262 917	24. Mai 2033	(4 567)
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	CHF	284 357	05. Mai 2028	(11 899)
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	EUR	368 812	05. Mai 2028	(40 810)
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	67 797	05. Mai 2028	(2 266)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	EUR	185 514	18. Mai 2033	(3 710)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Computer	Morgan Stanley	USD	1 890 045	18. Mai 2033	(32 690)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	43 306	24. Mai 2033	(3 688)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	EUR	238 899	05. Mai 2028	(6 155)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	56 579	18. Mai 2033	(5 593)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	USD	199 540	18. Mai 2033	1 057
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	EUR	61 474	24. Mai 2033	(7 472)
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	SEK	193 610	24. Mai 2033	1 016
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	J.P. Morgan	EUR	41 729	05. Mai 2028	(6 685)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 772 824	23. Mai 2033	(556)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2 066 742	24. Mai 2033	(46 361)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	AUD	225 527	05. Mai 2028	(3 728)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	191 227	05. Mai 2028	7 303
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	112 033	05. Mai 2028	(3 929)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	262 814	08. Mai 2028	19 279
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	448 324	05. Mai 2028	(31 851)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	AUD	422 801	18. Mai 2033	540
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	162 373	18. Mai 2033	(12 414)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	232 565	18. Mai 2033	1 917
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	4 718 954	18. Mai 2033	(147 789)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	GBP	70 522	24. Mai 2033	(3 062)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	241 868	24. Mai 2033	(1 924)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1 267 720	05. Mai 2028	(15 008)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	1 062 985	18. Mai 2033	11 920
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Goldman Sachs	EUR	90 089	24. Mai 2033	(2 719)
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	J.P. Morgan	EUR	39 250	05. Mai 2028	0
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	J.P. Morgan	USD	119 056	05. Mai 2028	(12 020)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	EUR	390 465	24. Mai 2033	(35 991)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	337 146	24. Mai 2033	(12 375)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	SEK	82 349	24. Mai 2033	(9 177)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	174 456	23. Mai 2033	8 132
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	115 301	24. Mai 2033	(7 674)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	DKK	139 996	05. Mai 2028	(12 026)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	8 804	08. Mai 2028	(285)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	SEK	7 671	05. Mai 2028	(649)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	EUR	111 737	18. Mai 2033	(8 875)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	96 611	18. Mai 2033	(6 182)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	102 536	18. Mai 2033	(4 102)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	DKK	502 967	24. Mai 2033	32 871
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	41 136	24. Mai 2033	(539)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	NOK	123 079	05. Mai 2028	7 542
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	83 936	05. Mai 2028	5 752
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	11 573	19. Mai 2033	937
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	200 115	24. Mai 2033	669
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	SEK	28 425	24. Mai 2033	(870)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	1 278	05. Mai 2028	2
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	SEK	206 909	05. Mai 2028	(13 508)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	96 531	18. Mai 2033	1 785
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	SEK	61 193	24. Mai 2033	153
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	191 523	23. Mai 2033	(1 286)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Unterhaltung	J.P. Morgan	SEK	430 408	05. Mai 2028	6 835
Verkauf Short	Unterhaltung	J.P. Morgan	USD	161 763	05. Mai 2028	4 188
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	SEK	29 094	18. Mai 2033	87
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	1 320 896	18. Mai 2033	6 411
Verkauf Short	Umweltschutz	J.P. Morgan	NOK	250 377	05. Mai 2028	(7 099)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	392 295	24. Mai 2033	(533)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	574 731	23. Mai 2033	(9 099)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	2 210 876	24. Mai 2033	33 143
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	689 670	05. Mai 2028	(12 484)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	1 254 502	18. Mai 2033	(5 198)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	1 558 256	17. Mai 2033	23 740
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	10 794 170	18. Mai 2033	(235 594)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	8 004	24. Mai 2033	(401)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	SEK	137 517	24. Mai 2033	(4 529)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	CHF	166 800	05. Mai 2028	383
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	262 723	05. Mai 2028	(9 692)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	SEK	115 418	05. Mai 2028	(2 823)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	43 843	18. Mai 2033	(94)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	329 542	18. Mai 2033	4 809
Verkauf Short	Gas	J.P. Morgan	USD	197 094	05. Mai 2028	(4 252)
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	USD	305 136	18. Mai 2033	5 086
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	608 911	24. Mai 2033	(34 861)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	1 302 130	24. Mai 2033	22 845
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	EUR	540 650	24. Mai 2033	(55 979)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	GBP	240 005	24. Mai 2033	(7 009)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	107 181	24. Mai 2033	(10 963)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	911 633	24. Mai 2033	(4 438)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	AUD	166 242	05. Mai 2028	11 582
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	CHF	119 735	05. Mai 2028	(21 516)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	200 109	05. Mai 2028	(7 649)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	EUR	118 971	05. Mai 2028	(5 440)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	JPY	183 940	08. Mai 2028	(13 145)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	2 897	05. Mai 2028	2 883
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	EUR	6 490	18. Mai 2033	249
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	1 478 702	18. Mai 2033	(1 931)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	317 022	24. Mai 2033	(2 033)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	502 815	24. Mai 2033	(34 149)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	37 846	05. Mai 2028	(3 097)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	310 443	18. Mai 2033	2 577
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 029 379	18. Mai 2033	41 199
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	453 445	18. Mai 2033	(21 300)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	EUR	155 321	05. Mai 2028	(12 720)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	262 382	18. Mai 2033	1 889
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	CHF	1 038 826	24. Mai 2033	(2 468)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	117 587	24. Mai 2033	(493)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	GBP	596 086	24. Mai 2033	(6 938)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	JPY	115 659	24. Mai 2033	(158)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	USD	218 882	23. Mai 2033	(1 989)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	1 328 992	05. Mai 2028	(8 670)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	J.P. Morgan	EUR	1 918 934	05. Mai 2028	1 679
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	617 329	05. Mai 2028	(1 694)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	JPY	298 157	08. Mai 2028	(18 951)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	USD	30 771	05. Mai 2028	(184)
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	1 144 563	18. Mai 2033	(27 613)
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	USD	256 663	17. Mai 2033	(754)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	EUR	16 949	24. Mai 2033	(3 493)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	GBP	61 517	24. Mai 2033	(6 312)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	HKD	121 633	24. Mai 2033	(58 960)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	432 087	23. Mai 2033	3 821
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	255 832	24. Mai 2033	(4 221)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	EUR	27 944	05. Mai 2028	(7 428)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	GBP	638 997	05. Mai 2028	(32 558)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	HKD	11 108	05. Mai 2028	(6 705)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	277 600	05. Mai 2028	(25 137)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	EUR	9 412	18. Mai 2033	(2 839)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	3 497 864	18. Mai 2033	(211 716)
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	EUR	49 583	24. Mai 2033	(789)
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	EUR	7 120	05. Mai 2028	358
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	EUR	93 857	18. Mai 2033	4 213
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	EUR	21 945	24. Mai 2033	(1 122)
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	39 650	23. Mai 2033	(222)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	EUR	268 017	05. Mai 2028	(9 235)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	134 711	05. Mai 2028	(3 959)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	1 168 642	18. Mai 2033	(22 639)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	GBP	251 092	24. Mai 2033	1 818
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	USD	337 456	23. Mai 2033	(9 849)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	GBP	289 565	05. Mai 2028	(24 653)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	HKD	6 268	05. Mai 2028	(2 800)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	SEK	40 633	05. Mai 2028	(2 761)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	HKD	131 201	18. Mai 2033	(55 617)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	945 643	18. Mai 2033	(107 938)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	SEK	85 190	05. Mai 2028	(4 311)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	6 922	24. Mai 2033	(922)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	13 956	24. Mai 2033	(693)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	173 249	24. Mai 2033	100
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	EUR	54 298	05. Mai 2028	(10 861)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	GBP	44 036	05. Mai 2028	(1 347)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	SEK	166 499	05. Mai 2028	(15 358)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	344 387	23. Mai 2033	(3 955)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	1 074 388	24. Mai 2033	13 974
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	163 584	05. Mai 2028	1 016
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	1 408 749	18. Mai 2033	(11 295)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	CHF	85 732	24. Mai 2033	(7 265)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	J.P. Morgan	CHF	18 355	05. Mai 2028	(1 590)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	EUR	434 118	24. Mai 2033	(27 583)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	EUR	147 374	05. Mai 2028	(13 646)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	36 027	18. Mai 2033	(824)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	AUD	290 966	24. Mai 2033	3 309

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Goldman Sachs	CAD	38 073	24. Mai 2033	(841)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	CAD	3 620	25. Mai 2033	11
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	54 989	24. Mai 2033	(801)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	89 222	24. Mai 2033	1 098
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	120 597	24. Mai 2033	800
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	AUD	245	05. Mai 2028	0
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	CAD	476 015	05. Mai 2028	30 509
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	EUR	43 229	05. Mai 2028	380
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	GBP	8 859	05. Mai 2028	27
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	2 515 949	05. Mai 2028	(62 975)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	AUD	320 304	18. Mai 2033	(14 512)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	1 479 617	18. Mai 2033	(7 982)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	GBP	10 174	18. Mai 2033	115
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	JPY	61 318	18. Mai 2033	(3 342)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	NOK	189 663	19. Mai 2033	2 981
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	1 967 604	18. Mai 2033	(1 777)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	40 168	24. Mai 2033	572
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	464 374	05. Mai 2028	(2 629)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	317 975	18. Mai 2033	3 616
Verkauf Short	Verpackung und Container	Goldman Sachs	EUR	60 785	24. Mai 2033	11 715
Verkauf Short	Verpackung und Container	J.P. Morgan	EUR	26 242	05. Mai 2028	5 786
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	51 097	24. Mai 2033	1 585
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	135 867	24. Mai 2033	7 547
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	755 291	24. Mai 2033	(9 205)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	47 462	24. Mai 2033	(858)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	464 732	05. Mai 2028	11 604
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	140 865	08. Mai 2028	9 740
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	645 126	18. Mai 2033	(8 860)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	124 129	18. Mai 2033	3 754
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2 090 574	18. Mai 2033	27 838
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	118 063	24. Mai 2033	(1 183)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	906 111	05. Mai 2028	(11 599)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	382 961	18. Mai 2033	(8 209)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	CHF	7 212	24. Mai 2033	(278)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	SEK	109 974	24. Mai 2033	5 288
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	220 671	23. Mai 2033	3 132
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	CHF	241 777	05. Mai 2028	(36 953)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	SEK	529 904	05. Mai 2028	(42 691)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	212 012	05. Mai 2028	(27 789)
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	SEK	691 464	18. Mai 2033	12 539
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	1 529 901	18. Mai 2033	(73 739)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	NOK	21 947	24. Mai 2033	158
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	SEK	71 799	24. Mai 2033	(2 379)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	74 540	23. Mai 2033	4 735
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	453 353	05. Mai 2028	(8 263)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	NOK	48 568	05. Mai 2028	(3 035)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	488 910	05. Mai 2028	(28 031)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	25 542	05. Mai 2028	(6 598)
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	EUR	104 905	18. Mai 2033	(874)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	42 745	18. Mai 2033	(1 571)
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	USD	116 238	18. Mai 2033	6 550
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	138 704	23. Mai 2033	(2 736)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	218 684	05. Mai 2028	(3 022)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	GBP	434 891	05. Mai 2028	(4 703)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	220 558	05. Mai 2028	(3 806)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1 102 748	18. Mai 2033	(16 831)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	321 529	24. Mai 2033	(29 721)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	267 942	24. Mai 2033	11 641
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	807 605	23. Mai 2033	(5 093)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	EUR	505 738	05. Mai 2028	(44 209)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	GBP	25 226	05. Mai 2028	(6 515)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	SEK	34 116	05. Mai 2028	(2 718)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	37 023	18. Mai 2033	(3 780)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	GBP	77 481	18. Mai 2033	(17 377)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	2 810 639	18. Mai 2033	(34 993)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	99 677	24. Mai 2033	(5 523)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	337 616	23. Mai 2033	(10 500)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	103 524	24. Mai 2033	(3 452)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	EUR	165 909	05. Mai 2028	(7 615)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	222 851	05. Mai 2028	(23 267)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	EUR	22 424	18. Mai 2033	(801)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	JPY	90 611	18. Mai 2033	(6 596)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	2 142 900	18. Mai 2033	(74 044)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	161 174	24. Mai 2033	(3 057)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	EUR	169 530	24. Mai 2033	(5 846)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	PLN	55 062	24. Mai 2033	484
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	5 286	24. Mai 2033	409
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	339 096	23. Mai 2033	(962)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	265 387	24. Mai 2033	(7 926)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	CHF	86 134	05. Mai 2028	(17)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	EUR	318 220	05. Mai 2028	(2 050)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	PLN	89 157	05. Mai 2028	(1 431)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	SEK	597 500	05. Mai 2028	(42 028)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	8 168	05. Mai 2028	(438)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	CHF	20 980	18. Mai 2033	141
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	SEK	37 826	18. Mai 2033	60
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	3 073 733	18. Mai 2033	(26 996)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	374 706	23. Mai 2033	(8 425)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	132 779	08. Mai 2028	516
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	36 972	05. Mai 2028	(3 222)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	789 674	18. Mai 2033	(5 132)
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	J.P. Morgan	JPY	39 440	08. Mai 2028	480
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Morgan Stanley	JPY	102 547	18. Mai 2033	(1 209)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	EUR	133 726	24. Mai 2033	1 251
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	EUR	254 643	05. Mai 2028	(10 580)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	40 119	18. Mai 2033	26
Verkauf Short	Wasser	Goldman Sachs	GBP	173 492	24. Mai 2033	732
Verkauf Short	Wasser	J.P. Morgan	GBP	441 378	05. Mai 2028	9 964

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Wasser	J.P. Morgan	USD	80 953	05. Mai 2028	228
Verkauf Short	Wasser	Morgan Stanley	GBP	35 836	18. Mai 2033	(51)
USD						(1 341 744)

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 („Einschusssumme“), 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 Geschäftsjahres zu erhaltende Dividenden behandelt. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Differenzkontrakten“ aufgeführt.

Zum 30. September 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	1 558 004	1 159 123	1 153 670
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	(416 875)	(404 565)	(519 218)
CFD auf chinesische Aktien	UBS	1 532 367	8 264 176	7 857 915
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	(222 000)	19 990	(24 702)
CFD auf Aktien aus Hongkong	UBS	1 992 800	1 696 944	1 767 250
CFD auf indonesische Aktien	UBS	(989 300)	(5 014)	(23 613)
CFD auf Aktien aus Macau	UBS	350 000	473 521	441 605
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	(30 811)	1 957	(12 435)
CFD auf neuseeländische Aktien	UBS	509 065	(134 407)	(261 041)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P.Morgan	(7 424)	13 914	2 902
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P.Morgan	541 230	13 260	243 532
CFD auf taiwanesischen Aktien	UBS	(1 764 000)	(30 663)	(30 663)
CFD auf britische Aktien	UBS	171 300	133 686	178 650
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(67 184)	(1 402)	1 683
CFD auf US-Aktien	UBS	281 057	(425 181)	(205 275)
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	UBS	(84 264)	(14 365 826)	(14 216 980)
			USD	(3 590 487)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	(421)	(267 633)	2 203
CFD auf Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	4 929	1 115 065	11 531
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	(488)	(314 697)	(13 244)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	1 478	2 204 681	92 811
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	1 364	1 095 692	18 049
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	665	597 563	10 954
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	(750)	(587 944)	(1 383)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	359	479 969	(25 173)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	1 397	1 375 258	37 825
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	1 968	886 809	22 240
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	2 414	1 227 917	701
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	1 334	497 322	(7 542)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	226	268 893	(2 809)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	1 256	668 957	34 086
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	341	313 627	(2 397)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	4 038	1 026 365	23 329
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	4 668	1 302 216	9 992
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	2 598	1 193 022	40 979

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)				
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	1 926	3 092 024	173 398
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	949	842 503	4 916
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	404	273 294	(9 631)
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	1 933	1 457 791	6 127
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	402	722 185	(13 358)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	1 293	1 483 149	46 910
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	594	2 615 810	56 828
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	5 261	3 197 110	88 724
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	1 966	806 610	48 698
			USD 27 573 558	654 764
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(24 739)	10 946	10 946
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	529 102	(334 189)	(334 189)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	38 245	350 252	350 252
CFD auf kanadische Aktien	Morgan Stanley	(303 210)	(15 633)	(15 633)
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	(191 685)	(33 575)	(33 575)
CFD auf finnische Aktien	Morgan Stanley	1 408 000	(22 951)	(22 951)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	(41 509)	(6 849)	(6 849)
CFD auf französische Aktien	Morgan Stanley	(22 273)	(35 914)	(35 914)
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	212 727	686 075	686 075
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	(857 027)	500 161	500 161
CFD auf indische Aktien	Morgan Stanley	(27 199)	120 492	120 492
CFD auf irische Aktien	Morgan Stanley	(23 836)	15 255	15 255
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(22 273)	(202 623)	(202 623)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(561 600)	(191 235)	(191 235)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	365 000	(835 263)	(835 263)
CFD auf taiwanische Aktien	Morgan Stanley	412 225	279 404	279 404
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1 081 110)	(2 854 658)	(2 854 658)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1 604 230)	(2 559 159)	(2 559 159)
			USD (5 129 464)	(5 129 464)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf argentinische Aktien	Goldman Sachs	1 746	3 143	3 143
CFD auf argentinische Aktien	J.P. Morgan	6 730	(27 189)	(27 189)
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	914 595	334 561	334 891
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	1 256 886	502 884	502 884
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	29 242	13 106	13 106
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	16 511	25 061	25 061
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	2 978	(37 982)	(37 982)
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	(17 090)	2 042	2 042
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	50 002	(80 933)	(80 933)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	12 604 258	(496 983)	(496 983)
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	1 251 606	(30 607)	(30 607)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	5 735	11 419	11 419
CFD auf chilenische Aktien	Goldman Sachs	13 146	30 481	30 481
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	5 951 395	4 189 737	4 193 088
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	1 525 494	6 483 991	6 483 991
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	20 050	(188 901)	(188 901)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	45 506	(242 793)	(242 793)
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	73 424	(79 714)	(79 714)
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	1 840	62 838	62 838
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	(3 298)	(2 632)	(2 632)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	50 348	(12 928)	(13 103)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	37 330	(24 917)	(24 917)
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	20 414	(76 670)	(76 670)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	125 385	237 175	236 975
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	39 726	188 502	188 502
CFD auf griechische Aktien	Goldman Sachs	(36 926)	865	865
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	1 882 225	675 225	675 149
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	1 003 500	938 102	938 102
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	35 316	(65 704)	(65 704)
CFD auf indonesische Aktien	J.P. Morgan	(798 600)	8 611	8 611
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	7 184	35 038	35 038
CFD auf irische Aktien	J.P. Morgan	1 625	7 248	7 248
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	29 482	(18 576)	(18 576)
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	65 801	(41 712)	(41 712)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	497 200	(224 609)	(224 609)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	7 409 900	2 686 121	2 686 121
CFD auf kasachische Aktien	Goldman Sachs	40 138	(447 094)	(447 094)
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	324 000	22 220	22 220
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	177 000	200 528	200 528
CFD auf mexikanische Aktien	Goldman Sachs	(15 478)	(7 746)	(7 746)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	(24 941)	34 435	34 435
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	338 331	(52 739)	(52 739)
CFD auf nigerianische Aktien	Goldman Sachs	171 676	(26)	(26)
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	121 908	126 597	126 597
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	88 258	29 982	29 982
CFD auf peruanische Aktien	Goldman Sachs	2 374	2 652	2 652
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	57 014	24 660	24 660
CFD auf portugiesische Aktien	Goldman Sachs	82 619	66 244	66 244
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	36 621	(8 174)	(8 174)
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	36 839	(7 977)	(7 977)
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	1 149 847	127 333	127 503
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	292 380	9 811	9 811
CFD auf slowenische Aktien	Goldman Sachs	6 532	(105)	(105)
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	92 087	376 801	376 801
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	143 479	132 625	132 597
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	216 275	44 475	44 475
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	(56 027)	48 609	48 609
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	73 902	(2 574)	(2 574)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(561 909)	103 963	103 963
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	6 677	99 561	99 561
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	(24 237)	(267 936)	(267 936)
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(830 000)	(14 726)	(14 726)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	636 972	2 667 591	2 377 356
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	503 582	(185 867)	(185 867)
CFD auf den FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(365)	(108 371)	(108 371)
CFD auf den FTSE UK MC Tradable Plus Index	Goldman Sachs	(278)	153	153
CFD auf den GSCBTUK3 Index	Goldman Sachs	(33 319)	(21 452)	(21 452)
CFD auf den GSHEJVL2 Index	Goldman Sachs	25 696 182	298 997	(82 758)
CFD auf den GSHEJVS2 Index	Goldman Sachs	(25 625 853)	(513 235)	(135 152)
CFD auf den GSXAMFSS Clone Index	Goldman Sachs	(2 451 572)	(181 419)	(181 419)
CFD auf den HXE Chemicals Hedge Index	Goldman Sachs	(40 073)	(144 010)	(144 010)
CFD auf den HXE Chemicals Index	Goldman Sachs	42 121	390 608	332 886
CFD auf den HXE Defence Index	Goldman Sachs	51 841	(123 352)	(123 352)
CFD auf den HXE ER Index	J.P. Morgan	(2 082)	(375 975)	(375 975)
CFD auf den HXE EU Value Long Index	Goldman Sachs	52 788	207 788	185 306
CFD auf den HXE EU Value Short Index	Goldman Sachs	(50 790)	(306 833)	(256 829)
CFD auf den HXE Japan Banks Index	Goldman Sachs	4 981 652	(398 421)	(398 421)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf den HXE TSMC Hedge Index	Goldman Sachs	30 624	258 466	258 466
CFD auf den HXE US Value Long Index	Goldman Sachs	84 919	480 962	342 384
CFD auf den HXE US Value Short Index	Goldman Sachs	(84 919)	(523 956)	(527 350)
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(43 067)	(7 096 580)	(7 096 580)
CFD auf den MSCI EM Latin America 10/40 Gross Total Return Index	Goldman Sachs	(1 923)	(5 315)	(5 315)
CFD auf den MSCI USA Equal Weighted Gross Total Return USD Index	Goldman Sachs	681	47 184	47 184
CFD auf den MSCI World Equal Weighted Index	Goldman Sachs	(750)	(188 823)	(188 823)
			USD 9 602 839	9 140 132
Schroder GAIA SEG US Equity				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	(51 999)	(403 385)	(394 674)
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	(25 429)	(121 512)	(120 915)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	136 543	708 446	711 457
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	6 312	41 710	42 122
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	(58 106)	(210 001)	(300 057)
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	(8 459)	(76 794)	(141 005)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	86 029	1 059 825	1 328 913
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	209 477	1 165 350	1 748 172
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(122 983)	(336 389)	4 436 811
CFD auf GS Commercial Real Estate Basket	Goldman Sachs	(11 469)	(175 205)	(257 126)
CFD auf den GS CORD Index	Goldman Sachs	(35 183)	(347 842)	(424 301)
CFD auf GS CSDN Basket	Goldman Sachs	(19 038)	(164 354)	(129 900)
CFD auf GS Healthcare Basket	Goldman Sachs	(20 261)	(15 803)	(45 735)
CFD auf GS Info Tech Basket	Goldman Sachs	(5 983)	(8 737)	(7 312)
CFD auf GS NRSI Basket	Goldman Sachs	(14 643)	(176 136)	(302 514)
CFD auf den GS OZVT Index	Goldman Sachs	(83 775)	(497 124)	(757 967)
CFD auf GS PEVC Basket	Goldman Sachs	(23 632)	(158 173)	(133 495)
CFD auf GS SCHN Basket	Goldman Sachs	(37 937)	28 057	(94 471)
CFD auf den GS SHIF Index	Goldman Sachs	(8 903)	(60 032)	(87 266)
CFD auf GS SPAC Basket	Goldman Sachs	(19 488)	(152 936)	(150 666)
CFD auf GS STHK Basket	Goldman Sachs	(11 254)	(266 832)	(266 832)
CFD auf JP Energy Basket	J.P. Morgan	(18 578)	101 352	101 542
CFD auf JP Flagship Basket	J.P. Morgan	(89 888)	(126 297)	(418 412)
CFD auf JP Utilities Basket	J.P. Morgan	(15 675)	(98 355)	(143 528)
			USD (291 167)	4 192 841

Credit Default Index-Swapkontrakte

Ein Credit Default Index Swap ermöglicht die Übertragung von Ausfallrisiken. Dadurch kann der 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 Schlusstermin auf dem Markt gehandelt wurde. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist zusammen mit allen ausstehenden/ zahlbaren Zinsen in Verbindung mit Credit Default Indizes in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Credit Default Index-Swapkontrakten“ aufgeführt.

Am 30. September 2024 waren die folgenden Teilfonds in Credit Default Index Swapkontrakten auf Finanzindizes engagiert:

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten%	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 42 20/12/2029	J.P. Morgan	EUR	35 000 000	5,00	20. Dez. 2029	3 267 039

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Credit Default Index-Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten%	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 42 20/12/2029	J.P. Morgan	EUR	139 000 000	1,00	20. Dez. 2029	3 139 942
Verkauf	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	47 000 000	5,00	20. Jun. 2029	3 696 327
Kauf	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	47 000 000	5,00	20. Jun. 2029	34 766
Verkauf	CDX North America High Yield Series 43 20/12/2029	J.P. Morgan	USD	47 000 000	5,00	20. Dez. 2029	(12 573)
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 43 20/12/2029	J.P. Morgan	USD	213 000 000	1,00	20. Dez. 2029	4 809 440
USD							14 934 941
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 42 20/12/2029	Citi Bank	EUR	26 000 000	1,00	20. Dez. 2029	(29 735)
Kauf	CDX North America Investment Grade Series 43 20/12/2029	Citi Bank	USD	10 000 000	1,00	20. Dez. 2029	1 623
USD							(28 112)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	CDX Emerging Markets Series 41 20/06/2029	Morgan Stanley	USD	4 527 000	1,00	20. Jun. 2029	(38 584)
Kauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 41 20/06/2029	Morgan Stanley	EUR	4 129 000	1,00	20. Jun. 2029	(19 236)
Kauf	CDX North America High Yield Series 43 20/12/2029	Morgan Stanley	USD	1 960 000	5,00	20. Dez. 2029	1 111
USD							(56 709)

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 30. September 2024 waren keine Teilfonds in Credit Default Swap-Kontrakten engagiert.

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 einem bestimmten Jahr auf zwei verschiedene Währungen lautende Zinszahlungen auszutauschen.

Zum 30. September 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	11 346 865	AUD	17 022 000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	3 900
Bank of America	USD	11 363 460	NOK	122 764 000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	6 689
Bank of America	USD	11 373 479	SEK	117 703 000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	6 741

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Cross-Currency Swapkontrakte (Forts.)

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeit	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)								
Morgan Stanley	USD	11 328 918	CAD	15 396 000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	CAD CORRA OIS 1 Tag	(12)
Morgan Stanley	USD	11 307 402	NZD	18 392 000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	(4 327)
USD								12 991

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 30. September 2024 war der folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
1 945 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,45%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(105 438)
5 529 000	USD	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,63%, erhält variablen Zinssatz auf USCPI, 10 Jahre	15. Sep. 2033	(99 139)
3 785 000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,48%, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	117 345
263 000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,60%, zahlt variablen Zinssatz auf USCPI, 5 Jahre	15. Sep. 2028	(2 007)
5 406 000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,61%, zahlt variablen Zinssatz auf USCPI, 5 Jahre	15. Sep. 2028	43 769
6 463 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,40%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(310 909)
6 463 000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,40%, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	172 623
USD					(183 756)

Zins-Swapkontrakte

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

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

Diese Kontrakte müssen auf die Währungen lauten, in denen die Vermögenswerte des 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 30. September 2024 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 9,72%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	170 000 000	MXN	16. Dez. 2026	(158 521)
Erhält Festzinssatz 9,20%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	170 000 000	MXN	16. Dez. 2026	77 298
Erhält Festzinssatz 7,04%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	300 000 000	ZAR	18. Dez. 2026	(1 601)
Zahlt Festzinssatz 12,09%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	87 584 337	BRL	04. Jan. 2027	131 174
Erhält Festzinssatz 8,76%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	23 946 154	MXN	06. Dez. 2034	9 734
Zahlt Festzinssatz 11,83%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	126 202 523	BRL	02. Jan. 2026	170 146

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 9,20%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	53 797 477	BRL	02. Jan. 2026	305 211
Erhält Festzinssatz 9,51%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	7 584 337	BRL	04. Jan. 2027	(75 300)
Erhält Festzinssatz 9,33%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	40 000 000	ZAR	18. Dez. 2034	133 858
Erhält Festzinssatz 9,24%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	40 000 000	ZAR	18. Dez. 2034	120 223
Erhält Festzinssatz 8,46%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	140 000 000	ZAR	18. Dez. 2029	333 145
Erhält Festzinssatz 8,39%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	70 000 000	ZAR	18. Dez. 2029	154 886
Erhält Festzinssatz 9,10%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	40 000 000	ZAR	18. Dez. 2034	98 463
Erhält Festzinssatz 1,27%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	16 000 000	CHF	18. Dez. 2034	1 277 005
Erhält Festzinssatz 2,41%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	100 000 000	SEK	18. Dez. 2034	174 545
Erhält Festzinssatz 1,06%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	6 000 000	CHF	18. Dez. 2029	212 746
Erhält Festzinssatz 1,06%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	12 000 000	CHF	18. Dez. 2029	425 492
Erhält Festzinssatz 2,17%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	20 000 000	SEK	18. Dez. 2034	(7 719)
Erhält Festzinssatz 3,89%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	9 270 976	NZD	18. Dez. 2034	8 475
Zahlt Festzinssatz 4,24%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	1 447 030	USD	18. Dez. 2049	(214 308)
Erhält Festzinssatz 3,15%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	8 647 030	USD	18. Dez. 2049	(288 947)
Erhält Festzinssatz 3,18%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	9 025 939	USD	18. Dez. 2044	(290 363)
Erhält Festzinssatz 2,03%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	180 000 000	SEK	18. Dez. 2029	40 535
Zahlt Festzinssatz 4,99%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	270 976	NZD	18. Dez. 2034	(16 024)
Zahlt Festzinssatz 4,86%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	1 118 899	NZD	18. Dez. 2029	(43 917)
Erhält Festzinssatz 3,47%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	19 118 899	NZD	18. Dez. 2029	(17 223)
Erhält Festzinssatz 7,04%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	150 000 000	ZAR	18. Dez. 2026	(800)
Erhält Festzinssatz 1,15%					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J. P. Morgan	2 084 302 402	JPY	18. Dez. 2044	(798 349)
Zahlt Festzinssatz 1,88%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J. P. Morgan	1 244 302 402	JPY	18. Dez. 2044	(654 455)
Zahlt Festzinssatz 4,76%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	33 715 619	USD	18. Dez. 2026	(965 937)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,30%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	41 715 619	USD	18. Dez. 2026	34 222
Erhält Festzinssatz 1,85%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	467 416 286	SEK	18. Dez. 2026	(62 684)
Zahlt Festzinssatz 3,36%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	123 416 286	SEK	18. Dez. 2026	(339 191)
Zahlt Festzinssatz 3,45%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J. P. Morgan	16 646 672	EUR	18. Dez. 2026	(468 032)
Zahlt Festzinssatz 4,38%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	4 943 594	USD	18. Dez. 2031	(355 944)
Erhält Festzinssatz 3,00%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	18 943 594	USD	18. Dez. 2031	(246 505)
Zahlt Festzinssatz 4,33%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	2 025 939	USD	18. Dez. 2044	(271 249)
Zahlt Festzinssatz 4,48%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	11 443 005	USD	18. Dez. 2028	(554 744)
Erhält Festzinssatz 2,95%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	27 443 005	USD	18. Dez. 2028	(224 908)
Erhält Festzinssatz 2,12%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J. P. Morgan	32 646 672	EUR	18. Dez. 2026	(8 977)
Zahlt Festzinssatz 3,34%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	900 000	USD	18. Dez. 2049	1 876
Zahlt Festzinssatz 9,41%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	23 946 154	MXN	06. Dez. 2034	(63 578)
Zahlt Festzinssatz 9,60%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	8 321 136	MXN	12. Dez. 2029	(19 764)
Erhält Festzinssatz 8,70%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	8 321 136	MXN	12. Dez. 2029	4 283
USD					(2 435 723)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 8,45%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	67 600 000	MXN	19. Jul. 2028	20 432
Erhält Festzinssatz 8,78%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16 155 000	MXN	21. Nov. 2033	5 363
Zahlt Festzinssatz 8,79%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92 095 000	MXN	27. Nov. 2028	(30 486)
Zahlt Festzinssatz 7,17%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1 713 496 000	COP	17. Jun. 2029	1 077
Zahlt Festzinssatz 2,22%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3 042 000	EUR	17. Sep. 2026	(19 517)
Erhält Festzinssatz 7,93%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 987 912 000	COP	19. Sep. 2034	(7 902)
Erhält Festzinssatz 8,21%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5 456 049 000	COP	20. Jun. 2034	7 075
Erhält Festzinssatz 8,58%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4 218 195 000	COP	19. Sep. 2034	14 914
Erhält Festzinssatz 8,62%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 503 840 000	COP	19. Sep. 2034	13 290

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,91%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2 121 000	MYR	17. Sept. 2029	(6 033)
Zahlt Festzinssatz 6,47%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	67 151 000	INR	16. Sept. 2029	(9 295)
Zahlt Festzinssatz 10,74%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10 495 187	BRL	02. Jan. 2026	33 493
Zahlt Festzinssatz 3,41%					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 6 Months	Morgan Stanley	2 362 000	CAD	19. Sep. 2034	(32 770)
Zahlt Festzinssatz 3,88%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6 061 000	USD	17. Dez. 2026	(58 759)
Zahlt Festzinssatz 10,93%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6 218 066	BRL	02. Jan. 2026	16 642
Zahlt Festzinssatz 3,28%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	10 129 885 000	KRW	18. Dez. 2034	(315 690)
Zahlt Festzinssatz 11,54%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	45 000 000	ZAR	19. Sep. 2034	(116 076)
Erhält Festzinssatz 8,59%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 759 926 000	COP	19. Dez. 2034	12 418
Zahlt Festzinssatz 6,44%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	201 722 000	HUF	19. Dez. 2034	(3 341)
Erhält Festzinssatz 6,24%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	59 260 000	INR	18. Dez. 2029	7 035
Erhält Festzinssatz 6,24%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	75 421 000	INR	18. Dez. 2029	8 961
Zahlt Festzinssatz 4,94%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	955 000	PLN	18. Dez. 2034	(10 131)
Erhält Festzinssatz 4,06%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	126 112 427	NOK	18. Dez. 2026	48 483
Erhält Festzinssatz 7,78%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 914 223 000	COP	18. Dez. 2029	31 774
Erhält Festzinssatz 5,34%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 404 000	PLN	18. Dez. 2025	1 143
Erhält Festzinssatz 7,47%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 969 563 000	COP	18. Dez. 2029	19 914
Erhält Festzinssatz 2,85%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4 755 554 000	KRW	18. Dez. 2026	6 792
Zahlt Festzinssatz 9,53%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92 917 000	MXN	11. Aug. 2026	(38 735)
Zahlt Festzinssatz 3,35%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8 776 000	CZK	18. Dez. 2034	(2 391)
Zahlt Festzinssatz 3,36%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9 886 000	CZK	18. Dez. 2034	(3 151)
Erhält Festzinssatz 2,66%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3 823 000	EUR	18. Sep. 2026	27 520
Zahlt Festzinssatz 4,46%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 824 000	PLN	18. Dez. 2029	(11 641)
Zahlt Festzinssatz 8,39%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5 331 418 000	COP	19. Dez. 2034	(10 284)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 11,92%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	7 021 528	BRL	04. Jan. 2027	10 173
Zahlt Festzinssatz 11,94%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6 898 950	BRL	04. Jan. 2027	9 712
Zahlt Festzinssatz 7,58%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10 501 000	ZAR	04. Mrz. 2030	(2 061)
Erhält Festzinssatz 8,77%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	14 619 000	ZAR	02. Mai 2035	10 811
Erhält Festzinssatz 8,06%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	14 779 000	ZAR	18. Dez. 2031	7 070
Zahlt Festzinssatz 5,63%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 763 435 000	HUF	18. Dez. 2025	(10 554)
Erhält Festzinssatz 5,51%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	498 910 000	HUF	18. Dez. 2031	5 086
Zahlt Festzinssatz 7,28%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	25 932 811 000	COP	18. Dez. 2029	(80 522)
Erhält Festzinssatz 7,79%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4 890 822 000	COP	18. Dez. 2034	29 646
Zahlt Festzinssatz 7,34%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10 552 524 000	COP	18. Dez. 2026	(20 817)
Zahlt Festzinssatz 11,71%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4 347 905	BRL	04. Jan. 2027	10 103
Erhält Festzinssatz 5,18%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	60 296 000	PLN	18. Dez. 2025	(3 983)
Erhält Festzinssatz 7,20%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	22 367 325 000	COP	18. Dez. 2027	46 134
Zahlt Festzinssatz 5,42%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	142 564 000	HUF	19. Mrz. 2030	(3 263)
Erhält Festzinssatz 3,34%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	21 012 000	NOK	19. Mrz. 2035	(9 981)
Erhält Festzinssatz 4,16%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9 201 000	ILS	19. Mrz. 2030	(1 007)
Zahlt Festzinssatz 4,82%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 086 390 000	CLP	18. Dez. 2034	(10 044)
Zahlt Festzinssatz 10,48%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	6 768 000	ZAR	20. Mrz. 2035	(3 455)
Erhält Festzinssatz 8,66%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	238 221 000	ZAR	19. Mrz. 2035	105 664
Erhält Festzinssatz 3,53%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	18 656 000	GBP	19. Mrz. 2027	(41 703)
Erhält Festzinssatz 2,59%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	64 793 000	CAD	19. Mrz. 2027	80 018
Zahlt Festzinssatz 2,81%					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	3 701 000	CAD	19. Mrz. 2035	12 530
Zahlt Festzinssatz 4,20%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 699 328 000	CLP	18. Dez. 2026	15
Erhält Festzinssatz 1,98%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	9 468 000	SGD	19. Mrz. 2027	(28 132)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 1,81%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	45 018 000	SEK	19. Mrz. 2027	(4 832)
Zahlt Festzinssatz 3,59%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1 181 000	AUD	19. Mrz. 2030	4 337
Zahlt Festzinssatz 5,99%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	121 915 000	INR	19. Mrz. 2027	(1 332)
Erhält Festzinssatz 6,84%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 696 641 000	COP	18. Dez. 2029	(4 875)
Zahlt Festzinssatz 6,70%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	15 958 473 000	COP	18. Dez. 2026	13 490
Erhält Festzinssatz 2,97%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	15 630 000	USD	19. Mrz. 2027	(40 429)
Erhält Festzinssatz 3,54%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1 324 000	USD	18. Sep. 2025	(761)
Erhält Festzinssatz 3,50%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1 324 000	USD	18. Sep. 2025	(1 196)
Erhält Festzinssatz 3,48%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1 290 000	USD	18. Sep. 2025	(1 344)
Zahlt Festzinssatz 3,07%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	105 020 000	CZK	18. Dez. 2026	(1 463)
Zahlt Festzinssatz 3,22%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	381 000	USD	18. Dez. 2034	2 476
Zahlt Festzinssatz 4,59%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	385 000	ILS	18. Dez. 2034	(1 215)
Erhält Festzinssatz 3,32%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 3 Months	Morgan Stanley	205 230 000	CZK	18. Dez. 2025	4 016
Zahlt Festzinssatz 7,48%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 087 973 000	COP	18. Dez. 2034	(1 682)
Erhält Festzinssatz 3,48%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1 289 000	USD	18. Sep. 2025	(1 291)
Erhält Festzinssatz 2,24%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2 138 000	SGD	18. Dez. 2026	16
Erhält Festzinssatz 8,47%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	5 834 000	ZAR	18. Dez. 2034	(123)
Zahlt Festzinssatz 5,99%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	66 256 000	INR	18. Dez. 2026	(1 151)
Zahlt Festzinssatz 6,92%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8 995 114 000	COP	18. Dez. 2026	(1 094)
Zahlt Festzinssatz 9,33%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	15 290 000	MXN	24. Feb. 2028	(15 621)
Zahlt Festzinssatz 8,76%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	39 665 000	MXN	11. Apr. 2028	(7 229)
Zahlt Festzinssatz 8,45%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36 765 000	MXN	14. Jun. 2028	10 890
Erhält Festzinssatz 9,27%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13 340 000	MXN	31. Aug. 2033	26 298
Zahlt Festzinssatz 9,38%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	52 500 000	MXN	06. Sep. 2028	(69 070)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 9,02%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20 725 000	MXN	01. Sep. 2033	23 565
Erhält Festzinssatz 9,60%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42 185 000	MXN	16. Sep. 2033	127 981
Erhält Festzinssatz 9,43%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	17 665 000	MXN	03. Okt. 2033	43 841
Erhält Festzinssatz 9,31%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8 700 000	MXN	24. Okt. 2033	18 405
Zahlt Festzinssatz 3,53%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 714 000	ILS	17. Jun. 2029	14 972
Zahlt Festzinssatz 6,41%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	444 215 000	INR	17. Jun. 2029	(55 795)
Erhält Festzinssatz 2,64%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	9 947 000	CNY	17. Jun. 2029	30 511
Erhält Festzinssatz 3,47%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4 684 000	USD	17. Jun. 2029	58 977
Erhält Festzinssatz 4,38%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 143 000	NZD	17. Jun. 2029	67 366
Erhält Festzinssatz 8,51%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	7 605 000	MXN	08. Dez. 2033	(4 258)
Zahlt Festzinssatz 3,56%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	5 771 000	ILS	17. Jun. 2029	22 267
Erhält Festzinssatz 8,47%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6 712 500	MXN	04. Jan. 2034	(4 741)
Zahlt Festzinssatz 3,73%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	5 348 000	ILS	17. Jun. 2029	14 351
Erhält Festzinssatz 9,12%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27 864 000	MXN	15. Jan. 2027	6 785
Zahlt Festzinssatz 3,28%					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1 677 000	GBP	17. Jun. 2029	8 620
Erhält Festzinssatz 2,86%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	803 000	SGD	20. Jun. 2034	8 671
Erhält Festzinssatz 2,91%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	580 000	SGD	20. Jun. 2034	7 187
Erhält Festzinssatz 5,35%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	231 805 000	CLP	21. Jun. 2034	2 495
Zahlt Festzinssatz 2,47%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 170 000	EUR	17. Jun. 2029	(12 982)
Zahlt Festzinssatz 0,34%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	9 970 497 000	JPY	19. Jun. 2026	60 808
Erhält Festzinssatz 5,45%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 059 055 000	CLP	21. Jun. 2034	62 768
Zahlt Festzinssatz 8,76%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	12 235 000	MXN	27. Feb. 2029	(3 967)
Zahlt Festzinssatz 3,84%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 646 000	AUD	16. Sept. 2029	(44 044)
Erhält Festzinssatz 4,59%					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	4 595 000	AUD	19. Sep. 2034	40 075

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,69%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	4 483 000	GBP	17. Sep. 2026	34 026
Erhält Festzinssatz 3,50%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1 002 000	GBP	19. Sep. 2034	(4 594)
Zahlt Festzinssatz 3,44%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	54 481 000	NOK	17. Sep. 2026	(8 438)
Zahlt Festzinssatz 3,38%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	51 941 000	NOK	19. Sep. 2034	(12 611)
Erhält Festzinssatz 3,11%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6 980 023 000	KRW	17. Sep. 2026	25 505
Zahlt Festzinssatz 3,76%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	1 065 000	MYR	17. Sept. 2029	(2 003)
Erhält Festzinssatz 2,83%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1 231 000	SGD	16. Sept. 2029	13 975
Erhält Festzinssatz 5,36%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	253 841 000	CLP	20. Sep. 2034	2 995
Zahlt Festzinssatz 4,19%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	20 276 000	NZD	17. Sep. 2026	(147 758)
Zahlt Festzinssatz 8,36%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	281 032 000	MXN	16. Sep. 2026	(12 605)
Erhält Festzinssatz 9,27%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	35 615 000	MXN	24. Mrz. 2027	18 017
Zahlt Festzinssatz 8,92%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42 805 000	MXN	27. Mrz. 2029	(27 579)
Erhält Festzinssatz 3,93%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 478 000	CZK	19. Sep. 2034	5 025
Zahlt Festzinssatz 6,97%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	528 389 000	HUF	16. Sept. 2029	(62 620)
Zahlt Festzinssatz 6,91%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	459 766 000	HUF	16. Sept. 2029	(52 726)
Erhält Festzinssatz 4,75%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 293 000	PLN	16. Sept. 2029	33 741
Erhält Festzinssatz 4,78%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3 500 000	PLN	16. Sept. 2029	19 339
Zahlt Festzinssatz 11,78%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16 640 000	ZAR	19. Sep. 2034	(49 427)
Erhält Festzinssatz 9,79%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	21 270 000	MXN	12. Mai 2027	25 452
Erhält Festzinssatz 5,37%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	703 158 000	CLP	20. Sep. 2034	6 600
Erhält Festzinssatz 2,19%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	4 375 000	CNY	16. Sept. 2029	4 631
Zahlt Festzinssatz 11,79%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9 323 000	ZAR	19. Sep. 2034	(27 841)
Zahlt Festzinssatz 3,95%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	19 999 000	CZK	18. Dez. 2034	(51 997)
Erhält Festzinssatz 4,00%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	68 090 000	CZK	18. Dez. 2026	55 365

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,91%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	59 987 000	CZK	18. Dez. 2029	104 674
Erhält Festzinssatz 3,98%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14 844 000	CZK	19. Dez. 2034	11 908
Zahlt Festzinssatz 6,26%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 908 327 000	HUF	18. Dez. 2025	(43 318)
Erhält Festzinssatz 6,03%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2 384 159 000	HUF	17. Dez. 2026	74 210
Erhält Festzinssatz 6,12%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	3 182 838 000	HUF	18. Dez. 2026	157 163
Zahlt Festzinssatz 4,40%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9 415 000	ILS	18. Dez. 2025	(1 126)
Zahlt Festzinssatz 4,36%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	28 738 000	ILS	17. Dez. 2026	(27 309)
Erhält Festzinssatz 4,40%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	28 814 000	ILS	18. Dez. 2026	33 558
Erhält Festzinssatz 9,84%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	32 928 000	MXN	04. Jun. 2027	42 755
Zahlt Festzinssatz 4,16%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5 569 000	AUD	18. Dez. 2025	(15 552)
Zahlt Festzinssatz 6,35%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	410 495 000	INR	18. Dez. 2026	(32 066)
Erhält Festzinssatz 6,31%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	294 403 000	INR	18. Dez. 2029	45 120
Zahlt Festzinssatz 5,09%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15 647 000	PLN	18. Dez. 2034	(213 787)
Zahlt Festzinssatz 4,75%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	17 178 000	PLN	17. Dez. 2026	(36 235)
Erhält Festzinssatz 5,12%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3 599 000	PLN	18. Dez. 2026	8 514
Erhält Festzinssatz 3,28%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4 472 555 000	KRW	18. Dez. 2026	34 574
Erhält Festzinssatz 3,25%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	9 486 609 000	KRW	18. Dez. 2029	169 247
Zahlt Festzinssatz 3,10%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5 554 000	SGD	18. Dez. 2025	(32 373)
Erhält Festzinssatz 3,78%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7 493 000	USD	19. Dez. 2034	74 436
Zahlt Festzinssatz 9,37%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8 888 000	MXN	12. Dez. 2029	(16 647)
Erhält Festzinssatz 9,33%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	52 789 000	MXN	06. Dez. 2034	122 477
Zahlt Festzinssatz 5,23%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	709 589 000	CLP	18. Dez. 2034	(32 714)
Zahlt Festzinssatz 11,69%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	53 628 000	ZAR	19. Sep. 2034	(151 380)
Erhält Festzinssatz 3,73%					

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	7 324 000	MYR	18. Dez. 2029	22 783
Zahlt Festzinssatz 3,62%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	4 952 000	MYR	18. Dez. 2026	(5 375)
Zahlt Festzinssatz 11,62%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27 466 000	ZAR	19. Sep. 2034	(74 572)
Zahlt Festzinssatz 3,16%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	21 676 000	SEK	18. Dez. 2025	(22 145)
Erhält Festzinssatz 2,56%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	66 385 000	SEK	16. Dez. 2029	84 931
Erhält Festzinssatz 2,72%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	37 778 000	SEK	18. Dez. 2029	77 966
Erhält Festzinssatz 2,91%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9 208 000	EUR	18. Dez. 2029	322 513
Zahlt Festzinssatz 4,25%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	81 606 000	NOK	18. Dez. 2025	(26 126)
Erhält Festzinssatz 4,69%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1 147 000	NZD	19. Dez. 2034	7 848
Erhält Festzinssatz 4,53%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1 715 000	NZD	18. Dez. 2034	15 842
Erhält Festzinssatz 10,15%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	2 260 000	MXN	01. Jun. 2034	11 363
Erhält Festzinssatz 10,16%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	2 260 000	MXN	01. Jun. 2034	11 402
Erhält Festzinssatz 10,22%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	3 145 000	MXN	01. Jun. 2034	16 572
Zahlt Festzinssatz 10,81%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	8 239 000	ZAR	19. Sep. 2034	(11 656)
Erhält Festzinssatz 2,63%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	14 372 000	SEK	19. Sep. 2034	13 122
Zahlt Festzinssatz 4,99%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	994 000	PLN	18. Dez. 2029	(8 239)
Zahlt Festzinssatz 11,05%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12 342 000	ZAR	19. Dez. 2034	(19 524)
Erhält Festzinssatz 4,13%					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	8 685 000	AUD	17. Dez. 2026	48 648
Erhält Festzinssatz 10,68%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	85 685 000	MXN	15. Jul. 2025	23 867
Erhält Festzinssatz 9,64%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 465 000	MXN	13. Jul. 2027	33 435
Zahlt Festzinssatz 6,37%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	274 854 000	HUF	19. Dez. 2034	(2 783)
Zahlt Festzinssatz 3,78%					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5 592 000	GBP	18. Sept. 2029	(19 883)
Erhält Festzinssatz 4,97%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	316 507 000	CLP	18. Dez. 2029	9 659
Erhält Festzinssatz 10,78%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	135 455 000	MXN	18. Jul. 2025	43 861

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 9,77%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46 790 000	MXN	16. Jul. 2027	60 741
Erhält Festzinssatz 10,82%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	90 120 000	MXN	21. Jul. 2025	31 189
Erhält Festzinssatz 3,94%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	20 947 300	NZD	18. Dez. 2026	123 075
Zahlt Festzinssatz 4,95%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	944 000	PLN	18. Dez. 2034	(10 167)
Zahlt Festzinssatz 4,96%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 625 000	PLN	18. Dez. 2034	(17 667)
Zahlt Festzinssatz 5,28%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	741 850 000	CLP	18. Dez. 2034	(37 329)
Zahlt Festzinssatz 5,27%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	961 270 000	CLP	18. Dez. 2034	(47 901)
Erhält Festzinssatz 4,97%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 363 711 000	CLP	18. Dez. 2026	38 656
Erhält Festzinssatz 5,00%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 739 151 000	CLP	18. Dez. 2026	29 251
Zahlt Festzinssatz 5,27%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	386 598 000	CLP	18. Dez. 2034	(19 248)
Erhält Festzinssatz 3,26%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14 765 000	CZK	18. Dez. 2029	6 029
Erhält Festzinssatz 5,02%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	632 321 000	CLP	18. Dez. 2029	20 923
Erhält Festzinssatz 5,06%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	603 487 000	CLP	18. Dez. 2029	21 113
Zahlt Festzinssatz 2,97%					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	4 908 000	CAD	17. Dez. 2026	(19 761)
Zahlt Festzinssatz 6,27%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	266 061 000	HUF	19. Dez. 2034	(248)
Erhält Festzinssatz 6,11%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	102 655 000	INR	18. Dez. 2029	5 644
Zahlt Festzinssatz 2,45%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	566 000	SGD	18. Dez. 2034	(997)
Erhält Festzinssatz 2,28%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	3 422 000	SGD	18. Dez. 2026	2 475
Erhält Festzinssatz 2,82%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 918 725 000	KRW	18. Dez. 2026	1 739
Erhält Festzinssatz 2,85%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 582 598 000	KRW	18. Dez. 2026	2 202
Erhält Festzinssatz 2,47%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 575 000	EUR	18. Sept. 2029	21 636
Erhält Festzinssatz 9,05%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6 923 000	MXN	09. Aug. 2027	2 884
Erhält Festzinssatz 10,21%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	139 380 000	MXN	11. Aug. 2025	20 034
Erhält Festzinssatz 10,27%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92 808 000	MXN	12. Aug. 2025	15 863

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,88%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	135 756 000	HUF	18. Dez. 2034	5 222
Erhält Festzinssatz 5,88%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	80 160 000	HUF	18. Dez. 2034	3 084
Erhält Festzinssatz 5,22%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	27 357 000	PLN	18. Dez. 2025	1 190
Erhält Festzinssatz 5,06%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	27 388 000	PLN	18. Dez. 2025	(9 312)
Zahlt Festzinssatz 4,68%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 423 000	PLN	19. Dez. 2034	(2 455)
Zahlt Festzinssatz 4,68%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 455 000	PLN	19. Dez. 2034	(2 332)
Erhält Festzinssatz 3,28%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	45 573 000	CZK	18. Dez. 2026	9 010
Erhält Festzinssatz 3,26%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	40 139 000	CZK	18. Dez. 2026	7 249
Zahlt Festzinssatz 9,59%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46 105 000	MXN	18. Aug. 2026	(22 115)
Zahlt Festzinssatz 2,13%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	17 787 000	SEK	18. Sept. 2029	(11 155)
Zahlt Festzinssatz 2,28%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	43 322 000	SEK	18. Sep. 2026	(13 759)
Erhält Festzinssatz 2,96%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 943 586 000	KRW	19. Dez. 2034	5 004
Erhält Festzinssatz 7,77%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	69 604 930 000	COP	18. Dez. 2025	44 855
Erhält Festzinssatz 3,38%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 3 Months	Morgan Stanley	251 981 000	CZK	18. Dez. 2025	11 572
Zahlt Festzinssatz 3,13%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	284 557 000	CZK	18. Dez. 2026	(19 774)
Zahlt Festzinssatz 5,25%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 033 651 000	HUF	18. Dez. 2026	(29 029)
Erhält Festzinssatz 5,38%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 682 753 000	HUF	18. Dez. 2029	36 703
Erhält Festzinssatz 6,04%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	278 528 000	INR	18. Dez. 2026	2 508
Zahlt Festzinssatz 6,00%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	228 732 000	INR	18. Dez. 2029	2 058
Zahlt Festzinssatz 4,27%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	55 800 000	PLN	18. Dez. 2029	(11 358)
Erhält Festzinssatz 4,41%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11 696 000	PLN	18. Dez. 2034	(2 708)
Zahlt Festzinssatz 7,08%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	22 316 000	ZAR	18. Dez. 2026	(699)
Erhält Festzinssatz 10,41%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	35 784 000	ZAR	19. Dez. 2034	22 391
Erhält Festzinssatz 8,66%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	78 885 000	ZAR	18. Dez. 2034	57 337

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,54%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	217 690 000	ZAR	18. Dez. 2029	(43 843)
Zahlt Festzinssatz 8,67%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	158 876 000	ZAR	18. Dez. 2034	(121 731)
Erhält Festzinssatz 5,68%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	280 067 000	HUF	18. Dez. 2031	10 421
Erhält Festzinssatz 2,23%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	358 000	SGD	18. Dez. 2029	(764)
Erhält Festzinssatz 2,23%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	615 000	SGD	18. Dez. 2029	(1 460)
Zahlt Festzinssatz 3,25%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	55 319 000	CZK	19. Mrz. 2035	4 229
Erhält Festzinssatz 3,00%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	126 714 000	CZK	19. Mrz. 2027	6 224
Erhält Festzinssatz 3,06%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22 514 000	CZK	19. Mrz. 2030	1 050
Erhält Festzinssatz 5,16%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	153 223 000	HUF	19. Mrz. 2027	1 451
Zahlt Festzinssatz 4,38%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 409 000	PLN	19. Mrz. 2035	(35)
Erhält Festzinssatz 4,40%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	56 028 000	PLN	19. Mrz. 2027	16 397
Zahlt Festzinssatz 4,20%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3 399 000	PLN	19. Mrz. 2030	(1 410)
Zahlt Festzinssatz 4,41%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 361 000	ILS	19. Mrz. 2035	888
Zahlt Festzinssatz 4,10%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	16 488 000	ILS	19. Mrz. 2026	5 138
Zahlt Festzinssatz 6,95%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	194 724 000	ZAR	19. Mrz. 2027	4 933
Zahlt Festzinssatz 7,53%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	208 599 000	ZAR	19. Mrz. 2030	(10 074)
Zahlt Festzinssatz 6,93%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	108 177 000	ZAR	18. Mrz. 2027	1 321
Zahlt Festzinssatz 3,22%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	85 175 000	NOK	17. Mrz. 2030	26 830
Erhält Festzinssatz 7,16%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	124 973 000	ZAR	18. Dez. 2025	(2 387)
Erhält Festzinssatz 10,33%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	29 260 000	ZAR	19. Dez. 2034	13 517
Erhält Festzinssatz 4,25%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	748 169 000	CLP	18. Dez. 2029	(3 903)
Erhält Festzinssatz 4,34%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 157 994 000	CLP	18. Dez. 2029	(696)
Zahlt Festzinssatz 4,19%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 780 884 000	CLP	18. Dez. 2026	387
Zahlt Festzinssatz 9,11%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	336 022 000	MXN	18. Mrz. 2026	(47 751)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 8,70%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	533 468 000	MXN	17. Mrz. 2027	117 201
Zahlt Festzinssatz 8,55%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	204 743 000	MXN	13. Mrz. 2030	(75 512)
Erhält Festzinssatz 8,75%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42 311 000	MXN	07. Mrz. 2035	18 710
Zahlt Festzinssatz 7,24%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	11 711 578 000	COP	18. Dez. 2025	6 034
Zahlt Festzinssatz 3,29%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	6 060 000	MYR	19. Mrz. 2027	2 166
Erhält Festzinssatz 3,41%					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	14 257 000	MYR	19. Mrz. 2030	(6 870)
Zahlt Festzinssatz 3,50%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	9 984 000	MYR	17. Mrz. 2030	1 204
Erhält Festzinssatz 2,74%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 219 242 000	KRW	19. Mrz. 2027	1 195
Erhält Festzinssatz 2,73%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	509 325 000	KRW	17. Mrz. 2030	11
Erhält Festzinssatz 1,56%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	17 936 000	CNY	19. Mrz. 2027	(2 349)
Erhält Festzinssatz 6,00%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	243 122 000	INR	19. Mrz. 2030	(1 063)
Erhält Festzinssatz 0,97%					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	27 245 000	JPY	19. Mrz. 2035	(170)
Zahlt Festzinssatz 1,28%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	24 216 000	JPY	21. Mrz. 2035	216
Zahlt Festzinssatz 2,23%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2 778 000	SGD	19. Mrz. 2035	37 040
Zahlt Festzinssatz 2,38%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 462 000	EUR	19. Mrz. 2035	(54 745)
Erhält Festzinssatz 2,16%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10 090 000	EUR	19. Mrz. 2027	35 270
Zahlt Festzinssatz 2,75%					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	9 572 000	CAD	19. Mrz. 2026	(11 269)
Zahlt Festzinssatz 2,53%					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	11 101 000	CAD	19. Mrz. 2030	(555)
Zahlt Festzinssatz 3,47%					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5 794 000	GBP	19. Mrz. 2035	78 059
Erhält Festzinssatz 3,38%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5 604 000	GBP	19. Mrz. 2030	(42 842)
Zahlt Festzinssatz 1,78%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	59 654 000	SEK	18. Mrz. 2027	4 844
Zahlt Festzinssatz 2,16%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	36 173 000	SEK	19. Mrz. 2035	22 961
Erhält Festzinssatz 2,97%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	17 674 000	USD	19. Mrz. 2030	(100 958)
Zahlt Festzinssatz 3,13%					

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13 154 000	USD	19. Mrz. 2035	138 287
Erhält Festzinssatz 3,94%					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	5 879 000	AUD	19. Mrz. 2035	(41 030)
Erhält Festzinssatz 3,28%					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	8 274 000	AUD	19. Mrz. 2027	(10 717)
Zahlt Festzinssatz 3,41%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 234 000	NZD	19. Mrz. 2030	4 298
Zahlt Festzinssatz 4,19%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 383 000	PLN	18. Dez. 2029	1 485
Zahlt Festzinssatz 3,31%					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	71 734 000	GBP	17. Sep. 2026	108 118
Erhält Festzinssatz 4,07%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5 818 603 000	CLP	17. Dez. 2026	(4 095)
Erhält Festzinssatz 4,33%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5 632 511 000	CLP	19. Mrz. 2030	(5 540)
Zahlt Festzinssatz 4,66%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3 922 416 000	CLP	19. Mrz. 2035	20 559
Zahlt Festzinssatz 8,21%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	85 211 000	MXN	17. Mrz. 2027	(6 197)
Erhält Festzinssatz 3,19%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	63 852 000	NOK	19. Mrz. 2030	(34 271)
Erhält Festzinssatz 2,17%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2 404 000	SGD	17. Mrz. 2030	(9 598)
Erhält Festzinssatz 3,13%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 597 000	USD	19. Mrz. 2026	(2 155)
Erhält Festzinssatz 3,08%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	45 968 000	CZK	18. Dez. 2029	978
Zahlt Festzinssatz 3,11%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	64 426 000	CZK	18. Dez. 2026	(3 100)
Zahlt Festzinssatz 9,13%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	49 932 000	MXN	15. Sep. 2026	(5 008)
Zahlt Festzinssatz 4,60%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 969 000	ILS	18. Dez. 2034	(6 714)
Zahlt Festzinssatz 7,79%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16 362 000	ZAR	17. Dez. 2029	(159)
Zahlt Festzinssatz 7,48%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10 178 000	ZAR	18. Dez. 2029	(573)
Zahlt Festzinssatz 9,98%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	30 856 000	ZAR	19. Dez. 2034	2 568
Erhält Festzinssatz 2,31%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1 205 000	SGD	18. Dez. 2029	891
Zahlt Festzinssatz 0,47%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	588 065 000	JPY	18. Dez. 2026	(564)
Zahlt Festzinssatz 2,83%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 802 437 000	KRW	18. Dez. 2034	(2 330)
USD					1 092 413

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2024 bestand das folgende Risiko bei in Bezug auf Derivatkontrakte einzufordernden/(zahlbare) Sicherheiten je Kontrahent:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene/ (gezahlte) Sicherheiten
Schroder GAIA Asian Equity Long Short				
	HSBC	Barmittel	USD	660 000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	140 000
	UBS	Barmittel	AUD	54 447
			USD	837 642
Schroder GAIA BlueTrend				
	HSBC	Barmittel	USD	2 690 000
	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	1 404 422
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	5 416 557
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	28 002 542
	J.P. Morgan	Barmittel	ZAR	13 828 168
			USD	39 181 726
Schroder GAIA Cat Bond				
	HSBC	Barmittel	USD	(6 080 000)
			USD	(6 080 000)
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
	HSBC	Barmittel	USD	610 000
			USD	610 000
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Barmittel	EUR	426 196
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
			EUR	426 198
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	103 138
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	1 761 997
	Goldman Sachs	Barmittel	JPY	40 424 790
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	3 682 592
	HSBC	Barmittel	USD	550 000
	J.P. Morgan	Barmittel	AUD	797 240
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	14 306
	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	131 541
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	2 702 720
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	170 500
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2 683 871
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	153 091 673
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	30 505 119
			USD	42 853 554
Schroder GAIA Oaktree Credit				
	HSBC	Barmittel	USD	40 000
			USD	40 000
Schroder GAIA SEG US Equity				
	HSBC	Barmittel	USD	210 000
			USD	210 000
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	HSBC	Barmittel	USD	90 000
			USD	90 000

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene/ (gezahlte) Sicherheiten
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Barmittel	EUR	1 870 405
	HSBC	Barmittel	USD	380 000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	586 000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	1 193 956
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	17 725 229
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	148 000
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	89 241 459
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	310 597
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	132 930
	Société Générale	Barmittel	CAD	55
	Société Générale	Barmittel	CHF	15
	Société Générale	Barmittel	CZK	2
	Société Générale	Barmittel	EUR	47
	Société Générale	Barmittel	JPY	4 857
	Société Générale	Barmittel	MXN	1
	Société Générale	Barmittel	SEK	1 838 244
	Société Générale	Barmittel	USD	17 883 002
	Société Générale	Barmittel	ZAR	3 070 840
			USD	42 916 086
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Barclays Bank	Barmittel	USD	670 000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	253 047
	HSBC	Barmittel	USD	2 300 000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	146 000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	213
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	11 078
	Morgan Stanley	Barmittel	CZK	2 621
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	423
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	19 876
	Morgan Stanley	Barmittel	ILS	222
	Morgan Stanley	Barmittel	NOK	153
	Morgan Stanley	Barmittel	NZD	237
	Morgan Stanley	Barmittel	SEK	1 603
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	330 000
	UBS	Barmittel	USD	80 000
			USD	3 814 928

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 das Berichtsjahr fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	81 401
Schroder GAIA BlueTrend	USD	145 088
Schroder GAIA Cat Bond	USD	46 886
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	461 862

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Ausweis von Transaktionskosten (Forts.)

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	192 070
Schroder GAIA Helix	USD	845 380
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	5 685
Schroder GAIA SEG US Equity	USD	112 670
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	182 180
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	125 176
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	747 633

Dividenden

Während des Berichtsjahres 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	08. Jan. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	303 962,29	USD	25,794514
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch.	23,82	USD	1,479462
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert	137,99	CHF	1,289272
			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.	26,23	USD	1,614408
			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	1,587250
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	28 026,76	GBP	1,536468
12. Jan. 2024	19. Jan. 2024	26. Jan. 2024	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
			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
28. Mrz. 2024	02. Apr. 2024	09. Apr. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	442 610,60	USD	31,065015
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch.	24,54	USD	1,502583
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert	155,75	CHF	1,435754

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Dividenden (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR-abgesichert	164,13	EUR	1,523088
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert	159,36	GBP	1,468059
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch.	27,35	USD	1,660721
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF-abgesichert	170,88	CHF	1,562691
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in EUR-abgesichert	179,97	EUR	1,657785
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert	174,71	GBP	1,596070
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch.	27,62	USD	1,673068
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF-abgesichert	175,37	CHF	1,599784
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR-abgesichert	184,76	EUR	1,698320
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	28 685,37	GBP	1,638163
12. Apr. 2024	19. Apr. 2024	26. Apr. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	5 221,39	USD	7,362155
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2 505,04	USD	8,763484
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	5 117,58	SGD	11,616090
10 Mai 2024	17 Mai 2024	24 Mai 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	5 292,82	USD	7,462773
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2 516,20	USD	8,802211
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	5 054,30	SGD	11,467240
14. Jun. 2024	21. Jun. 2024	28. Jun. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	7 774,64	USD	8,552201
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2 886,04	USD	10,095642
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	5 821,29	SGD	13,201398
27. Jun. 2024	28. Jun. 2024	05. Jul. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	497 994,30	USD	34,724391
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch.	23,92	USD	1,443647
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert	143,18	CHF	1,300301
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR-abgesichert	158,41	EUR	1,448930
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert	153,26	GBP	1,391588
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch.	26,19	USD	1,564348
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF-abgesichert	157,75	CHF	1,419411
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in EUR-abgesichert	174,33	EUR	1,580837
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert	168,84	GBP	1,518454
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch.	1 547,12	USD	1,600277
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF-abgesichert	162,45	CHF	1,457489
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR-abgesichert	179,19	EUR	1,620780
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	25 697,34	GBP	1,558127
12. Jul. 2024	19. Jul. 2024	26. Jul. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	7 821,25	USD	7,046109
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2 373,68	USD	8,303079
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	4 729,53	SGD	10,719700
09. Aug. 2024	16. Aug. 2024	23. Aug. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	19 668,83	USD	7,538087
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2 540,23	USD	8,885354
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	5 045,51	SGD	11,430707
13. Sep. 2024	20. Sep. 2024	27. Sep. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	36 322,51	USD	8,896230
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	3 003,94	USD	10,506948

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Dividenden (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
27. Sep. 2024	30. Sep. 2024	07. Okt. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	6 329,06	SGD	13,532894
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	483 282,00	USD	34,648490
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI Aussch.	4 668 631,13	USD	90,810690
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI, Aussch., in GBP abgesichert	2 770 922,11	GBP	8,662257
			Schroder GAIA BlueTrend, Klasse C, Aussch., in GBP abgesichert	56 559,91	GBP	2,280214
			Schroder GAIA BlueTrend, Klasse E, Aussch., in GBP abgesichert	279 806,57	GBP	2,341818
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch.	126,37	USD	8,561766
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in EUR abgesichert	733,84	EUR	7,066298
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in GBP abgesichert	5 010,18	GBP	7,250412
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch.	25,16	USD	1,497527
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert	146,21	CHF	1,310007
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR-abgesichert	162,75	EUR	1,468341
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert	157,22	GBP	1,408246
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch.	27,40	USD	1,612652
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF-abgesichert	161,14	CHF	1,428530
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in EUR-abgesichert	179,44	EUR	1,603013
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert	173,38	GBP	1,536416
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch.	2 509,77	USD	1,648290
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF-abgesichert	165,83	CHF	1,465311
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR-abgesichert	184,43	EUR	1,642767
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	22 903,19	GBP	1,572788

Gegenseitige Anlagen der Teilfonds

Zum 30. September 2024 belaufen sich die gegenseitigen Anlagen der Teilfonds auf insgesamt 10 499 933 EUR, daher würde der kombinierte Gesamt-NIW am Jahresende ohne gegenseitige Anlagen 5 750 293 556 EUR betragen. Die Einzelheiten zu den gegenseitigen Anlagen der Teilfonds sind in der folgenden Tabelle angegeben:

Anlage	Währung des Teilfonds	Markt- wert	% des Nettovermögens
Schroder GAIA Helix			
Schroder GAIA Asian Equity Long Short		11 688 000	3,81
	USD	11 688 000	3,81

Änderungen in den Teilfonds

Eine Auflistung sämtlicher Käufe und Verkäufe aller Teilfonds, die während des Berichtsjahres durchgeführt wurden, ist auf Anfrage kostenlos beim Sitz der Gesellschaft erhältlich.

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 30. September 2024 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 1,11315 US-Dollar

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

1. Neue Anteilsklassen

Nach dem Berichtsjahr wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelegt:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse Y5 Thes.	USD	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Aussch.	USD	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Aussch., in GBP abgesichert	GBP	USD	25. Oktober 2024

2. Auflösungen von Anteilsklassen

Nach dem Berichtsjahr wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelöst:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA Helix			
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	28. Oktober 2024
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	SGD	USD	28. Oktober 2024
Klasse C1 Thes.	USD	USD	28. Oktober 2024
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	JPY	USD	28. Oktober 2024

3. Wesentliche Ereignisse nach dem Geschäftsjahr

Der Hurrikan Milton („Milton“) bildete sich im westlichen Golf von Mexiko und zog als Kategorie-5-Sturm nach Osten, bevor er nach Nordosten in Richtung Florida und der Tampa Bay Area drehte. Milton traf am 9. Oktober 2024 als Kategorie-3-Sturm in der Nähe von Siesta Key in Florida an Land und durchquerte die Florida-Halbinsel in nordöstlicher Richtung als Kategorie-1-Sturm. Die Auswirkungen von Milton auf den Teilfonds GAIA Cat Bond waren unerheblich, mit einem Rückgang des Anlagewerts um weniger als 1%.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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.	11	0,66%	Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes.	3 748	0,58%	Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse E Thes.	0	0,00%	Klasse IF Aussch.	n. z. #	n. z. #
Klasse E Thes. EUR	0	0,00%	Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	247 710	0,90%
Klasse I Thes.	n. z. #	n. z. #	Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	557 356	1,13%
Klasse IZ Thes.	15	0,89%	Klasse PI Aussch.	682 919	1,27%
Klasse IZ Thes. EUR	1	0,04%	Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	472 351	1,33%
Klasse X1 Thes.	239	0,02%	Klasse X Thes.	n. z. #	n. z. #
Klasse X1 Thes. EUR	4	0,03%	Klasse X Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse X1 Thes. GBP	6	0,00%	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	3 645	0,02%	Klasse Y Thes.	n. z. #	n. z. #
Schroder GAIA BlueTrend			Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse A Thes.	0	0,00%	Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse Y1 Thes.	n. z. #	n. z. #
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes.	0	0,00%	Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	5 461	0,02%	Klasse Y2 Thes.	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse E Thes.	0	0,00%	Klasse A Thes.	758 865	5,43%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	17 195	4,13%
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	158 791	4,53%
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	34 438	5,48%
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse A1 Thes.	32 560	4,65%
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes.	4 864 520	6,20%
Schroder GAIA Cat Bond			Klasse C Thes., in BRL abgesichert	163 969	0,82%
Klasse A Thes.	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	113 822	4,15%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1 971 363	5,05%
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	2 720 960	5,56%
Klasse A Aussch.	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes., in SEK abgesichert	361 171	5,31%
Klasse C Thes.	n. z. #	n. z. #	Klasse E Thes.	38 334	6,54%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	5 588	3,53%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	161 411	5,27%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1 194	5,63%
Klasse F Thes.	n. z. #	n. z. #	Schroder GAIA Egerton Equity		
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse A Thes.	1 434 478	2,61%
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse A Thes., in GBP abgesichert	58 798	2,71%
Klasse F Aussch.	n. z. #	n. z. #	Klasse A Thes., in USD abgesichert	2 061 343	2,87%
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse A Aussch. GBP	11 339	2,41%
Klasse I Thes.	n. z. #	n. z. #	Klasse A1 Thes.	40 307	2,43%
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	501 666	2,64%
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes.	4 667 079	3,00%
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	721 890	3,10%
Klasse IF Thes.	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes., in USD abgesichert	3 656 866	3,32%
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse C Aussch.	40 759	3,08%

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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 Aussch. GBP	24 540	3,00%	Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	11 694	0,55%
Klasse E Thes.	74	2,52%	Klasse R3 Thes.	799 576	1,07%
Klasse X Thes.	52 692	2,07%	Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Schroder GAIA Helix			Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	654	0,00%
Klasse A Thes.	0	0,00%	Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	60 038	0,73%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	587	0,15%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	4 611	0,07%
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%	Schroder GAIA Sirios US Equity		
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes.	3 316 487	3,45%
Klasse C Thes.	0	0,00%	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	17 414	3,23%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	351 508	3,39%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes.	2 076 691	3,64%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	101 008	3,86%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	526 987	3,62%
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	187 115	3,76%
Klasse C1 Thes.	0	0,00%	Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	2 905	3,46%
Klasse E Thes.	0	0,00%	Klasse E Thes.	988	2,81%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	29 565	2,85%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse X Thes.	71	3,72%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	472	3,71%
Klasse I Thes.	n. z. #	n. z. #	Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z. #	n. z. #	Klasse C Thes.	4 835 524	2,59%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	44	0,00%
Klasse S Aussch.	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	38 462	1,43%
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1 604 731	2,24%
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	2 153 755	3,97%
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse K Thes.	1 285 409	2,48%
Schroder GAIA SEG US Equity			Klasse K Thes., in CHF abgesichert	708	1,00%
Klasse C Thes.	64 456	3,33%	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	94 207	1,62%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	2 671	3,18%	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	59 908	3,05%	Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	210 165	3,65%	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse IZ Thes.	280 424	6,32%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	3 422	2,75%	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	183 315	6,07%	Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	549	3,97%	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0	0,00%
Klasse K Thes.	62	3,79%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	341	2,83%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	394	3,38%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	519	3,77%	Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse R1 Thes.	64 652	0,93%	Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	237	0,00%	Klasse E Thes.	0	0,00%
Klasse R2 Thes.	557 399	1,28%	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	42 116	0,04%	Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

Gesamtkostenquote („TER“)[^] für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
-----------------------------	-----	--

Schroder GAIA Asian Equity Long Short		
Klasse A Thes.	2,99%	0,66%
Klasse C Thes.	1,97%	0,58%
Klasse E Thes.	1,20%	0,00%
Klasse E Thes. EUR	1,16%	0,00%
Klasse I Thes.	0,15%	n. z. [#]
Klasse IZ Thes.	2,03%	0,89%
Klasse IZ Thes. EUR	1,13%	0,04%
Klasse X1 Thes.	1,02%	0,02%
Klasse X1 Thes. EUR	1,02%	0,03%
Klasse X1 Thes. GBP	1,00%	0,00%
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	1,03%	0,02%

Schroder GAIA BlueTrend		
Klasse A Thes.	2,00%	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,03%	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,03%	0,00%
Klasse C Thes.	1,40%	0,00%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,45%	0,02%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse E Thes.	1,40%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	1,46%	0,00%

Schroder GAIA Cat Bond		
Klasse A Thes.	1,78%	n. z. [#]
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	1,82%	n. z. [#]
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	1,83%	n. z. [#]
Klasse A Aussch.	1,96%	n. z. [#]
Klasse C Thes.	1,38%	n. z. [#]
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,40%	n. z. [#]
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,41%	n. z. [#]
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,40%	n. z. [#]
Klasse F Thes.	1,73%	n. z. [#]
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	1,74%	n. z. [#]
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	1,74%	n. z. [#]
Klasse F Aussch.	1,73%	n. z. [#]
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1,74%	n. z. [#]

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
-----------------------------	-----	--

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse I Thes.	0,15%	n. z. [#]
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	0,16%	n. z. [#]
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	0,16%	n. z. [#]
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,15%	n. z. [#]
Klasse IF Thes.	1,33%	n. z. [#]
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	1,32%	n. z. [#]
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	1,34%	n. z. [#]
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	1,33%	n. z. [#]
Klasse IF Aussch.	1,33%	n. z. [#]
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	1,52%	0,90%
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	1,75%	1,13%
Klasse PI Aussch.	1,87%	1,27%
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	1,95%	1,33%
Klasse X Thes.	0,90%	n. z. [#]
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	0,91%	n. z. [#]
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,91%	n. z. [#]
Klasse Y Thes.	1,07%	n. z. [#]
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	1,11%	n. z. [#]
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	1,10%	n. z. [#]
Klasse Y1 Thes.	1,46%	n. z. [#]
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	1,51%	n. z. [#]
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	1,51%	n. z. [#]
Klasse Y2 Thes.	0,50%	n. z. [#]
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	0,53%	n. z. [#]
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	0,53%	n. z. [#]
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	0,53%	n. z. [#]

Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse A Thes.	7,86%	5,43%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	6,60%	4,13%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	6,99%	4,53%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	7,94%	5,48%
Klasse A1 Thes.	7,58%	4,65%
Klasse C Thes.	7,88%	6,20%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	2,60%	0,82%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	5,87%	4,15%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	6,76%	5,05%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	7,28%	5,56%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	7,02%	5,31%
Klasse E Thes.	7,97%	6,54%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	5,00%	3,53%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	6,73%	5,27%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	7,10%	5,63%

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

Legende:

[^] Die Gesamtkostenquote (TER) wurde gemäss den Leitlinien für die Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) kollektiver Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufspreis der Wertpapiere (falls vorhanden) enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebskosten behandelt werden, sind in der Berechnung der TER nicht enthalten. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die TER wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr auf das Jahr umgerechnet.

[#] Performancegebühr wird der Anteilsklasse/dem Teilfonds nicht berechnet.

Gesamtkostenquote („TER“)[^] für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
-----------------------------	-----	--

Schroder GAIA Egerton Equity

Klasse A Thes.	5,05%	2,61%
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	5,18%	2,71%
Klasse A Thes., in USD abgesichert	5,34%	2,87%
Klasse A Aussch. GBP	4,86%	2,41%
Klasse A1 Thes.	5,37%	2,43%
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	5,61%	2,64%
Klasse C Thes.	4,69%	3,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	4,82%	3,10%
Klasse C Thes., in USD abgesichert	5,04%	3,32%
Klasse C Aussch.	4,77%	3,08%
Klasse C Aussch. GBP	4,69%	3,00%
Klasse E Thes.	4,15%	2,52%
Klasse X Thes.	3,66%	2,07%

Schroder GAIA Helix

Klasse A Thes.	2,44%	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47%	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,47%	0,00%
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,48%	0,00%
Klasse C Thes.	1,39%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,42%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,42%	0,00%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,12%	0,00%
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	1,41%	0,00%
Klasse C1 Thes.	1,35%	0,00%
Klasse E Thes.	1,00%	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,97%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,00%	0,00%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,00%	0,00%
Klasse I Thes.	0,16%	n. z. [#]
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,11%	n. z. [#]
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,16%	0,00%
Klasse S Aussch.	0,59%	0,00%
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0,64%	0,00%
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0,63%	0,00%
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,78%	0,00%

Schroder GAIA Oaktree Credit

Klasse A2 Thes.	1,56%	n. z. [#]
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	1,59%	n. z. [#]
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	1,59%	n. z. [#]
Klasse A2 Aussch.	1,53%	n. z. [#]

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
-----------------------------	-----	--

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	1,58%	n. z. [#]
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	1,58%	n. z. [#]
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	1,58%	n. z. [#]
Klasse C Thes.	1,06%	n. z. [#]
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,09%	n. z. [#]
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,08%	n. z. [#]
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,07%	n. z. [#]
Klasse C Aussch.	1,02%	n. z. [#]
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	1,08%	n. z. [#]
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	1,07%	n. z. [#]
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,08%	n. z. [#]
Klasse E Thes.	0,90%	n. z. [#]
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,94%	n. z. [#]
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,93%	n. z. [#]
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,96%	n. z. [#]
Klasse E Aussch.	0,95%	n. z. [#]
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	0,93%	n. z. [#]
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	0,92%	n. z. [#]
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0,93%	n. z. [#]
Klasse I Thes.	0,15%	n. z. [#]

Schroder GAIA SEG US Equity

Klasse C Thes.	5,03%	3,33%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	4,88%	3,18%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	4,75%	3,05%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	5,35%	3,65%
Klasse IZ Thes.	7,72%	6,32%
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	4,19%	2,75%
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	7,50%	6,07%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	5,40%	3,97%
Klasse K Thes.	5,93%	3,79%
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	5,03%	2,83%
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	5,58%	3,38%
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	5,97%	3,77%
Klasse R1 Thes.	2,93%	0,93%
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	2,00%	0,00%
Klasse R2 Thes.	2,73%	1,28%
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	1,45%	0,00%
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	1,49%	0,04%
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	2,00%	0,55%
Klasse R3 Thes.	2,63%	1,07%
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	1,59%	0,00%
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	1,57%	0,00%

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

Legende:

[^] Die Gesamtkostenquote (TER) wurde gemäss den Leitlinien für die Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) kollektiver Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufspreis der Wertpapiere (falls vorhanden) enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebskosten behandelt werden, sind in der Berechnung der TER nicht enthalten. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die TER wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr auf das Jahr umgerechnet.

[#] Performancegebühr wird der Anteilsklasse/dem Teilfonds nicht berechnet.

Gesamtkostenquote („TER“)[^] für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA SEG US Equity (Forts.)		
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	2,29%	0,73%
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	2,75%	0,15%
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	1,39%	0,07%
Schroder GAIA Sirios US Equity		
Klasse A Thes.	5,88%	3,45%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	5,70%	3,23%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	5,85%	3,39%
Klasse C Thes.	5,32%	3,64%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	5,57%	3,86%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	5,33%	3,62%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	5,47%	3,76%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	5,17%	3,46%
Klasse E Thes.	4,19%	2,81%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	4,26%	2,85%
Klasse X Thes.	5,22%	3,72%
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	5,31%	3,71%
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse C Thes.	4,42%	2,59%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,91%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	3,29%	1,43%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	4,10%	2,24%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	5,83%	3,97%
Klasse K Thes.	4,81%	2,48%
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	3,36%	1,00%
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	3,98%	1,62%
Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse A Thes.	2,43%	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47%	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,47%	0,00%
Klasse C Thes.	1,68%	0,00%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1,72%	0,00%
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse E Thes.	1,18%	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,22%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,22%	0,00%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,21%	0,00%

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

Legende:

[^] Die Gesamtkostenquote (TER) wurde gemäss den Leitlinien für die Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) kollektiver Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufspreis der Wertpapiere (falls vorhanden) enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebskosten behandelt werden, sind in der Berechnung der TER nicht enthalten. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die TER wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr auf das Jahr umgerechnet.

Performancegebühr wird der Anteilsklasse/dem Teilfonds nicht berechnet.

Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

1. Commitment-Ansatz

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

Fonds

Schroder GAIA Sirios US Equity
Schroder GAIA Cat Bond
Schroder GAIA Oaktree Credit

2. Absoluter VaR-Ansatz

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

Fonds

Schroder GAIA Asian Equity Long Short
Schroder GAIA BlueTrend
Schroder GAIA Contour Tech Equity
Schroder GAIA Egerton Equity
Schroder GAIA Helix
Schroder GAIA Two Sigma Diversified
Schroder GAIA SEG US Equity
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Ausschöpfung des regulatorischen VaR-Limits

Teilfonds	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	Durchschnittliche Hebelung
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	7,17%	17,80%	13,36%	215,42%
Schroder GAIA BlueTrend	15,49%	55,14%	34,94%	1 603,20%
Schroder GAIA Contour Tech Equity	25,05%	39,94%	33,03%	145,84%
Schroder GAIA Egerton Equity	25,70%	34,18%	30,01%	133,16%
Schroder GAIA Helix	8,33%	15,03%	11,13%	604,99%
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	23,05%	39,15%	28,03%	703,19%
Schroder GAIA SEG US Equity	35,92%	52,93%	44,77%	127,83%
Schroder GAIA Wellington Pagosa	5,63%	9,67%	7,03%	816,40%

Angaben zum VaR-Modell

Teilfonds	Modelltyp	Konfidenzintervall	Haltedauer	Beobachtungszeitraum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Parameter-Simulation	99%	1 Monat	1 Jahr
Schroder GAIA BlueTrend	MonteCarlo-Simulation	99%	1 Monat	1 Jahr
Schroder GAIA Contour Tech Equity	MonteCarlo-Simulation	99%	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA Egerton Equity	MonteCarlo-Simulation	99%	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA Helix	Parameter-Simulation	99%	1 Monat	1 Jahr
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	MonteCarlo-Simulation	99%	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA SEG US Equity	MonteCarlo-Simulation	99%	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA Wellington Pagosa	MonteCarlo-Simulation	99%	1 Monat	3 Jahre

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

OGAW-Vergütungsangaben für die Schroder Investment Management Europe S.A. („SIM Europe“) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 74 bis 93 des Jahresberichts und Abschlusses für 2023 (verfügbar auf der Website – www.schroders.com/ir) gelesen werden, der weitere Informationen zu den Aktivitäten unseres Vergütungsausschusses und zu unseren Vergütungsgrundsätzen und -richtlinien bietet.

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

Der Vergütungsausschuss der Schroders plc hat eine Vergütungsrichtlinie aufgestellt, um sicherzustellen, dass die Anforderungen der OGAW-Richtlinie für alle OGAW-MRTs eingehalten werden. Der Vergütungsausschuss und der Verwaltungsrat der Schroders plc prüfen die Vergütungsstrategie mindestens jährlich. Der Verwaltungsrat der SIM Europe ist für die Verabschiedung der Vergütungspolitik und die regelmässige Überprüfung ihrer Umsetzung in Bezug auf die SIM Europe verantwortlich. Die Vergütungspolitik wurde im Jahr 2023 überprüft, um sicherzustellen, dass sie mit den OGAW/AIFMD-Vergütungsanforderungen konform ist, und es wurden keine erheblichen Änderungen vorgenommen.

Die Umsetzung der Vergütungsrichtlinie unterliegt mindestens einmal jährlich einer unabhängigen internen Prüfung der Einhaltung der vom Verwaltungsrat der SIM Europe und vom Vergütungsausschuss eingeführten Vergütungsrichtlinien und -verfahren. Die letzte Überprüfung ergab keine grundlegenden Probleme, aber es wurden kleinere Empfehlungen zur Richtliniendokumentation ausgesprochen.

Unser Verhältnis zwischen den operativen Vergütungskosten und dem Nettobetriebsergebnis gibt die jährlichen Gesamtausgaben für Vergütungen vor. Dies empfiehlt der Vergütungsausschuss dem Verwaltungsrat von Schroders plc. Dieser Ansatz richtet die Vergütung an der finanziellen Performance von Schroders aus. Im Rahmen der Bestimmung der Vergütungsausgaben für jedes Jahr werden die zugrunde liegende Stärke und Nachhaltigkeit des Unternehmens sowie Berichte zu Risiko und Compliance sowie Rechts- und Innenrevisionsangelegenheiten von den Leitern dieser Bereiche berücksichtigt.

Die nachstehenden Vergütungsdaten spiegeln die im Jahr 2023 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 342 Mitarbeiter gezahlten Vergütung belief sich auf 57,71 Mio. EUR, wovon 40,07 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 17,64 Mio. EUR auf variable Vergütungen (z. B. Jahresbonuszahlungen oder aufgeschobene Bonuszahlungen) entfielen. Mitarbeiter anderer Unternehmen der Schroders-Gruppe, die im Verwaltungsrat der SIM Europe sitzen, erhalten für ihre Rolle als Verwaltungsratsmitglieder der SIM Europe keine zusätzliche Vergütung.
- Die nachstehenden Angaben beziehen sich auf OGAW-MRTs der SIM Europe. Die meisten dieser OGAW-MRTs waren bei anderen Unternehmen der Schroders-Gruppe beschäftigt. Dazu gehören auch Anlageverwaltungsdienste oder andere Aufgaben, die von der SIM Europe an andere Unternehmen der Schroders-Gruppe oder Dritte übertragen wurden. Viele dieser OGAW-MRTs erbringen Leistungen für andere Unternehmen der Schroders-Gruppe und andere Kunden. Im Interesse der Transparenz spiegeln die nachstehenden Gesamtvergütungszahlen die vollständige Vergütung für jeden OGAW-MRT der SIM Europe wider. Die an die 237 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 gezahlte und der SIM Europe oder den von ihr verwalteten OGAW-Fonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 177,70 Mio. EUR, wovon 51,24 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 123,80 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW-Fonds übernehmen, und 2,64 Mio. EUR an andere OGAW-MRTs, einschliesslich MRTs mit Kontrollfunktionen, gezahlt wurden. Diese Gesamtvergütungswerte umfassen Beträge, die ggf. von Beauftragten gezahlt wurden.

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäss Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäss Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total-Return-Swaps für das Geschäftsjahr zum 30. September 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
6 977 364	1,42%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
8 703 382	1,77%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
15 680 746	3,19%

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	5 754 213
Merrill Lynch	4 293 397
J.P. Morgan	2 932 378
Goldman Sachs	2 700 758
	15 680 746

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

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	–	572 975	572 975
1 bis 3 Monate	–	166 445	166 445
3 bis 12 Monate	5 805 418	6 158 775	11 964 193
Mehr als 1 Jahr	1 171 946	1 805 187	2 977 133
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	6 977 364	8 703 382	15 680 746

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA
Merrill Lynch	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 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert EUR
Getrennt	14 306 902
Gepoolt	–
Andere	–
	14 306 902

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“, „Nettoverluste 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	16 033 326

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
33	0,00%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
20 518 371	6,68%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
20 518 404	6,68%

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	13 131 307
Goldman Sachs	6 475 211
Barclays Bank	859 983
Morgan Stanley	51 903
	20 518 404

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	–	–	–
1 bis 3 Monate	33	30	63
3 bis 12 Monate	–	20 518 341	20 518 341
Mehr als 1 Jahr	–	–	–
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	33	20 518 371	20 518 404

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (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	6 180 000
Gepoolt	–
Andere	–
	6 180 000

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“, „Nettoverluste aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwaches/(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	103 847 144

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
1 540 410	0,73%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4 864 134	2,32%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
6 404 544	3,05%

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	3 374 701
Goldman Sachs	2 114 284
Morgan Stanley	639 818
Barclays Bank	275 741
	6 404 544

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	–	132 801	132 801
1 bis 3 Monate	175 614	748 658	924 272
3 bis 12 Monate	995 827	3 207 880	4 203 707
Mehr als 1 Jahr	368 969	774 795	1 143 764
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	1 540 410	4 864 134	6 404 544

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	770 000
Gepoolt	–
Andere	–
	770 000

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“, „Nettoverluste 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	8 354 417

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

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
5 568 297	1,53%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
5 568 297	1,53%

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	5 568 297
	5 568 297

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	5 568 297	–	5 568 297
1 bis 3 Monate	–	–	–
3 bis 12 Monate	–	–	–
Mehr als 1 Jahr	–	–	–
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	5 568 297	–	5 568 297

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 II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	1 240 214
Gepoolt	–
Andere	–
	1 240 214

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“, „Nettoverluste 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	89 447 839

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
4 204 550	1,41%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4 712 975	1,58%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
8 917 525	2,99%

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	4 186 091
J.P. Morgan	3 226 308
Goldman Sachs	1 505 126
	8 917 525

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	–	–	–
1 bis 3 Monate	–	–	–
3 bis 12 Monate	–	–	–
Mehr als 1 Jahr	4 204 550	4 712 975	8 917 525
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	4 204 550	4 712 975	8 917 525

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 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 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“, „Nettoverluste 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	11 643 078

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Schroder GAIA Cat Bond
Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300MYKDUYVX3W6F39

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __%	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Die **EU-Taxonomie**

ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Der Fonds investierte:

- mindestens 80% seines Vermögens in Anlagen im Zusammenhang mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken mit dem Ziel, die negativen Folgen solcher Ereignisse zu verringern, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach einem solchen Ereignis beizutragen und damit deren künftige Widerstandsfähigkeit zu erhöhen;
- mindestens 50% seines Vermögens in Anlagen im Zusammenhang mit meteorologischen Risiken, um die negativen Folgen solcher Ereignisse zu verringern, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach einem solchen Ereignis beizutragen und damit deren künftige Widerstandsfähigkeit zu erhöhen sowie möglicherweise die negativen Folgen des Klimawandels zu mildern;
- mindestens 5% seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben.

Der Fonds wies ausserdem basierend auf dem Ratingsystem des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf.

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem proprietären Tool von Schroders gemessen, das eine aggregierte Schätzung der sozialen oder ökologischen Kosten und des sozialen oder ökologischen Nutzens bietet, die ein Emittent verursachen könnte. Dazu wird der Emittent anhand einer Liste von Indikatoren bewertet – die Bewertungen können positiv sein (z. B. wenn ein Emittent mehr als den durchschnittlichen existenzsichernden Lohn zahlt) oder negativ (z. B. wenn ein Emittent Kohlenstoff emittiert). Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeitsstools und -kennzahlen abweichen.

Das Ergebnis wird als Gesamtwert der Nachhaltigkeitsindikatoren für jeden Emittenten ausgedrückt, konkret als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes oder des BIP des jeweiligen Emittenten. Ein Wert von +2% würde beispielsweise bedeuten, dass je 100 US-Dollar Umsatz oder BIP, die der Emittent generiert, ein positiver Nettobeitrag für die Gesellschaft und/oder die Umwelt von 2 US-Dollar erbracht würde. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds ergibt sich aus den Bewertungen aller zulässigen Emittenten im Portfolio des Fonds, die anhand des proprietären Tools von Schroders ermittelt werden.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2023 und 30. September 2024.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

• **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, um mindestens wie folgt zu investieren: 80% seines Vermögens in mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbundene Anlagen; 50% seines Vermögens in mit meteorologischen Risiken verbundene Anlagen; und 5% seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben, durch den Einsatz eines Betriebssystems eines Drittanbieters für Anlageexperten, das von einem internen Portfolio-Compliance-Team überwacht wird.

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert des Fonds für den Referenzzeitraum betrug 0,7%. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird wie oben beschrieben berechnet.

Während des Referenzzeitraums handelte es sich bei den Top-5-Indikatoren im proprietären Tool von Schroders, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitrugen, um folgende:

- Bildung: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Bildungsausgaben eines Landes pro Kind im Schulalter;
- Finanzielle Inklusion: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Bereitstellung von Finanzdienstleistungen für die lokale Bevölkerung. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz;
- Hohe Löhne/Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen durch Bezahlung des Personals über dem örtlichen existenzsichernden Lohn (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort;
- Medizin: geschätzter gesellschaftlicher und gesamtwirtschaftlicher Nutzen durch das Angebot von medizinischen Produkten und Dienstleistungen. Berechnung nach dem Stellenwert des betreffenden Unternehmens innerhalb der Wertschöpfungskette des Gesundheitswesens und seinem weltweiten Marktanteil innerhalb des Teilssektors; und
- Gesellschaftspolitische Stabilität: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen, den ein politisch und sozial stabiles Land durch Unterstützung eines günstigen Umfelds für Unternehmen und eines attraktiven Investitionsklimas bieten kann, womit die Voraussetzungen für langfristiges Wirtschaftswachstum geschaffen werden.

Der Fonds wandte auch bestimmte Ausschlüsse an, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwachte.

• ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Nachhaltigkeitswert

Diese Tabelle zeigt die Entwicklung des Nachhaltigkeitswerts des Fonds gegenüber dem Vorjahr

Zeitraum	Fonds (%)
Okt. 2023 - Sep. 2024	0,7
Okt. 2022 - Sep. 2023	0,9
Okt. 2021 - Sep. 2022	0,8

• Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.

• Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie in den vorvertraglichen Informationen zum Fonds angegeben, ist der Anlageverwalter derzeit nicht in der Lage, die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen, da diese Kennzahlen nur für Anlagen in Unternehmen, Staatsanleihen und Immobilien gelten.

Aufgrund der Art der Vermögenswerte des Fonds, bei denen es sich um versicherungsgebundene Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente handelt, die Katastrophenrisiken ausgesetzt sind, könnte der Anlageverwalter nur nachteilige Auswirkungen berücksichtigen, die für diese Anlageklasse massgeblich sind. Der Anlageverwalter hat bestimmte Transaktionssponsoren und bestimmte Risikoklassen, die nach Ansicht des Anlageverwalters das Potenzial haben, erhebliche nachteilige Auswirkungen auf die Gesellschaft zu haben, von der Aufnahme in seine Portfolios ausgeschlossen.

Der Fonds hat ausserdem ILS-Transaktionen ausgeschlossen, die von den folgenden Unternehmen auf eigenständiger Basis gesponsert werden:

- Umwelt: Unternehmen, die in der Förderung und Produktion fossiler Brennstoffe (einschliesslich unter anderem Ölbohrungen und Kohlebergwerke) oder in der Stromerzeugung aus Öl und Gas tätig sind.

- Soziales: Unternehmen aus folgenden Sektoren: Alkohol, Tabak, Glücksspiel, Erwachsenenunterhaltung, konventionelle Waffen, zivile Schusswaffen und Kernwaffen.

Darüber hinaus hat der Fonds bestimmte Risikoklassen von der Aufnahme in sein Portfolio ausgeschlossen: Lotterie, Hypothekenversicherung, Lebensversicherungen und Terror auf eigenständiger Basis.



Welche waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 wichtigsten Investitionen im Bezugszeitraum waren:

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: **1. Okt. 2023 bis 30. Sep. 2024**

Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermö- genswerte	Land
NAKAMA RE LTD 1 FRN 144A 6,5961% 13. Okt. 2026	Finanzwesen	1,67	Singapur
TREASURY BILL SR GOVT 0% 25. Apr. 2024	Treasuries	1,60	USA
VoussoirRe_Jul_2023_Sidecar	Finanzwesen	1,55	Bermuda
TREASURY BILL SR GOVT 0% 15. Okt. 2024	Treasuries	1,39	USA
SUSSEX CAP UK PCC LTD 12,9619% 08. Jan. 2025	Finanzwesen	0,95	Vereinigtes Königreich
LIGHTNING RE SERIES 2023 15,5461% 31. Mrz. 2026	Finanzwesen	0,91	USA
FLOODSMART RE LTD 18,5461% 12. Mrz. 2027	Finanzwesen	0,89	Bermuda
KILIMANJARO III RE LTD A FRN 144A 10,3883% 25. Jun. 2025	Finanzwesen	0,84	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 11,25% 25. Feb. 2025	Finanzwesen	0,82	Bermuda
MYSTIC RE IV LTD 16,5409% 08. Jan. 2027	Finanzwesen	0,81	Bermuda
TREASURY BILL SR GOVT 0% 23. Mai 2024	Treasuries	0,80	USA
SANDERS RE III LTD 10,2909% 07. Apr. 2031	Finanzwesen	0,80	Bermuda
GATEWAY RE LTD 18,4983% 24. Feb. 2026	Finanzwesen	0,79	USA
QUEEN STREET 2023 RE DAC A FRN 144A 12,1019% 08. Dez. 2025	Finanzwesen	0,79	Irland
MERNA REINSURANCE II LTD 12,0683% 07. Jul. 2025	Finanzwesen	0,76	Bermuda

Aufgrund der Struktur dieser Vermögenswerte stellt das in der obigen Tabelle angegebene „Land“ den Sitz des Anlagevehikels dar. Die Länderrisikopositionen der zugrunde liegenden Anlagen werden in der Regel vom Sitzland abweichen.

Der dargestellte „Sektor“ stellt die Tatsache dar, dass es sich um Zweckgesellschaften handelt, die zum Zwecke der Risikominderung errichtet wurden.

Die obige Liste stellt den Durchschnitt der Fondsbeteiligungen an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Die Daten zu den grössten Investitionen und Prozentanteilen der oben genannten Vermögenswerte stammen aus dem Schroders Investment Book of Record (IBOR). Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten grössten Investitionen und prozentualen Anteile an Vermögenswerten sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu den grössten Investitionen und Prozentsätzen der Vermögenswerte geringfügig voneinander abweichen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation definiert den Anteil der Anlagen in bestimmten Vermögenswerten.

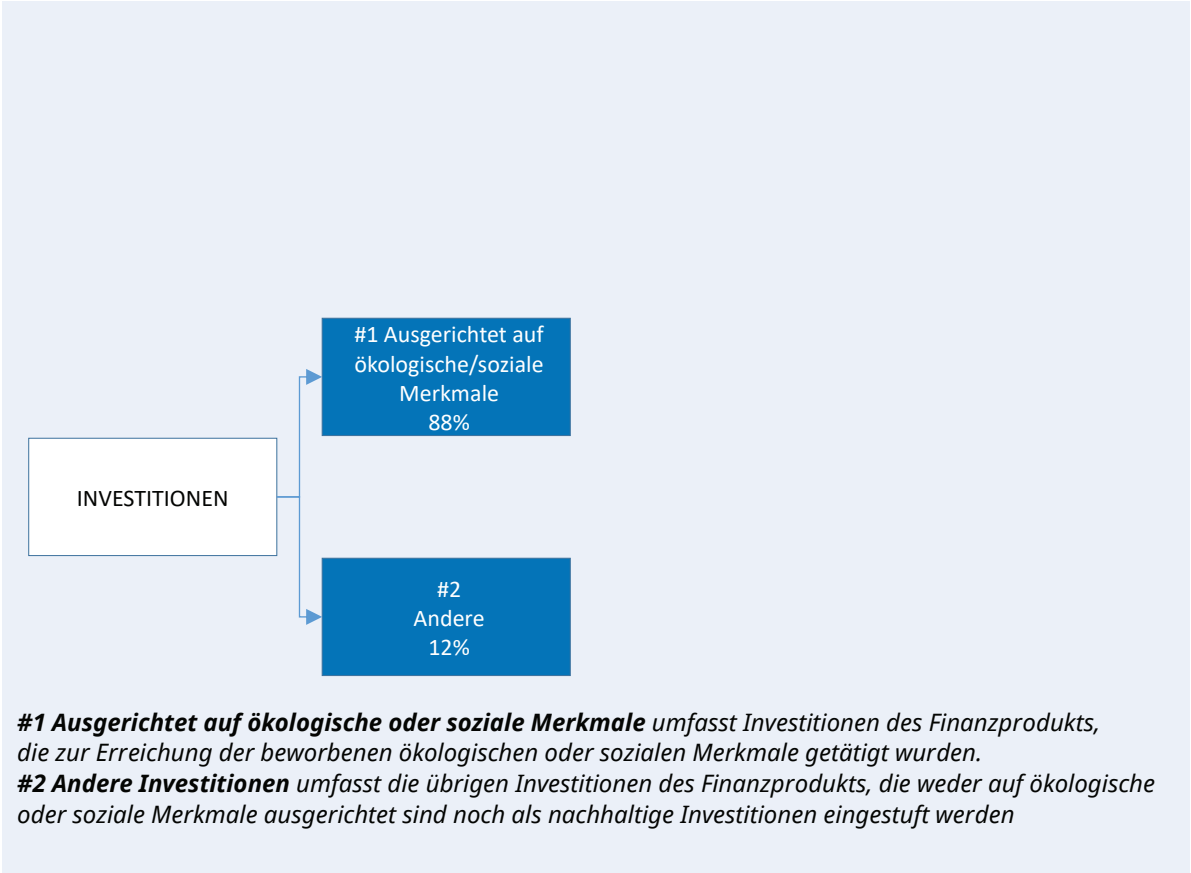
• Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Anlagen des Fonds, die genutzt werden, um seine ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst den Anteil des Fondsvermögens, der zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale eingesetzt wird. Dieser Anteil beträgt 88%. Dieser Prozentsatz entspricht dem Anteil der Vermögenswerte in Anlagen, die mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbunden sind, Anlagen, die mit meteorologischen Risiken verbunden sind, und Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben. Er basiert auf dem Durchschnitt der Bestände an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, die nicht in Bezug auf Nachhaltigkeit bewertet werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beitrugen.



• **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Im Referenzzeitraum wurden Investitionen in folgenden Wirtschaftssektoren getätigt:

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Finanzwesen	Versicherung	86,43
Barmittel	Barmittel	8,61
Treasuries	Treasuries	3,79
Supranational	Supranational	1,18
Derivate	Devisenderivate	-0,01

Die obige Liste stellt den Durchschnitt der Fondsbeteiligungen an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Die obigen Angaben zu den auf die Sektoren entfallenden Prozentanteilen des Vermögens sind dem Schroders Investment Book of Record (IBOR) entnommen. Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten Prozentanteile des Vermögens an den Sektoren sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu Prozentanteilen des Vermögens an einzelnen Sektoren geringfügig voneinander abweichen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Es gab keine definierte Mindest-Taxonomieausrichtung der Anlagen des Fonds (einschliesslich Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomieausrichtung der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und wird mit 0% des Fondsportfolios angegeben.

• Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Aktivitäten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

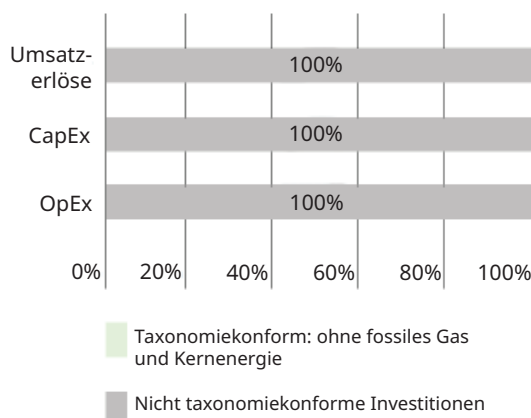
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

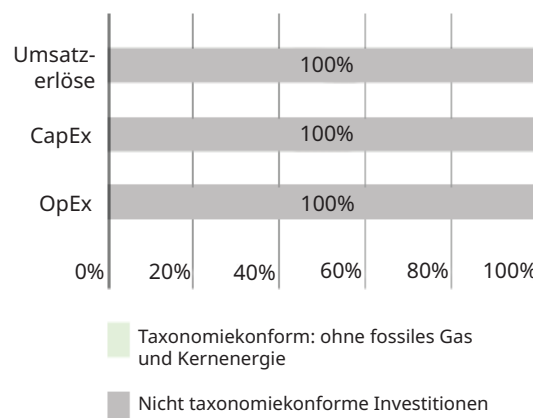
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt x% der Gesamtinvestitionen wieder²

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

²Da keine Taxonomiekonformität besteht, hat der Ausschluss von Staatsanleihen keine Auswirkungen auf das Diagramm (d. h. der Prozentsatz der Investitionen, die der Taxonomie entsprechen, bleibt bei 0%) und die Verwaltungsgesellschaft ist daher der Ansicht, dass es nicht notwendig ist, diese Information anzugeben.

Ermöglichen-de Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

• Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Wie oben beschrieben, wird der Anteil der Anlagen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten mit 0% des Fondsportfolios angenommen.

• Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Diese Frage ist nicht relevant.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, die nicht in Bezug auf Nachhaltigkeit bewertet werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitsstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitscore des Fonds beitrugen.

Mindestschutzregelungen wurden gegebenenfalls auf Geldmarktinstrumente und Derivate angewandt, die zur Risikominderung (Absicherung) verwendet wurden, oder auf andere Anlagen, indem (gegebenenfalls) Anlagen in Gegenparteien eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken) verbunden oder dort engagiert waren. Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Länder berücksichtigt; dabei wird auf eine Reihe von öffentlichen Erklärungen, Indizes und globale Staatsführungsindikatoren Bezug genommen, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der britischen Regierung, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NRO) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Kontrahenten durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft und die Zulassung eines neuen Kontrahenten basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld eines jeden Kontrahenten und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems sowie dessen aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein firmeneigenes Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Kontrahenten unterstützt.

Das Kreditrisikoteam von Schroders überwachte die Kontrahenten und soweit während des Bezugszeitraums Kontrahenten gemäss unseren Richtlinien und Compliance-Anforderungen aus der genehmigten Liste für alle Fonds entfernt wurden, waren diese Kontrahenten ab dem Zeitpunkt ihrer Entfernung in Bezug auf relevante Investitionen nicht mehr für den Fonds zugelassen.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden die folgenden Massnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen:

- Der Anlageverwalter wandte bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien an;
- Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Auswahl der vom Fonds gehaltenen Vermögenswerte die Nachhaltigkeitswerte des Fonds und der einzelnen Anlagen; und
- Der Anlageverwalter beurteilte die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Anlagen des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Referenzbenchmarks sind Indizes, die messen, ob Finanzprodukte die ökologischen oder sozialen Merkmale, auf die sie abzielen, tatsächlich fördern.

Es wurde kein Index als Benchmark festgelegt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

• *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Diese Frage ist nicht relevant.

• *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Diese Frage ist nicht relevant.

• *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Diese Frage ist nicht relevant.

• *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Diese Frage ist nicht relevant.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Schroder GAIA Helix
Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300HTRQHG6XKWC51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 63% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Der ausgewiesene Prozentsatz nachhaltiger Investitionen (bei denen es sich ausschliesslich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden) entspricht dem Anteil der nachhaltigen Anlagen am Long-Engagement des Fonds am Ende des Referenzzeitraums. Dies steht im Einklang mit den vorvertraglichen Informationen zu dem Fonds, in denen die Verpflichtung des Fonds festgelegt ist, mindestens 35% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Für zusätzlichen Kontext: Im Verhältnis zum Bruttoengagement des Fonds betrug der Anteil nachhaltiger Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums 31%. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Kauf- als auch Verkaufspositionen, und dieser Wert wird aus Gründen der Kohärenz mit den anderen Berechnungen im nachstehenden Abschnitt über die Vermögensallokation angegeben.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Der Fonds wies basierend auf dem Ratingsystem des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf.

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem proprietären Tool von Schroders gemessen, das eine aggregierte Schätzung der sozialen oder ökologischen Kosten und des sozialen oder ökologischen Nutzens bietet, die ein Emittent verursachen könnte. Dazu wird der Emittent anhand einer Liste von Indikatoren bewertet – die Bewertungen können positiv sein (z. B. wenn ein Emittent mehr als den durchschnittlichen existenzsichernden Lohn zahlt) oder negativ (z. B. wenn ein Emittent Kohlenstoff emittiert). Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeitstools und -kennzahlen abweichen.

Das Ergebnis wird als Gesamtwert der Nachhaltigkeitsindikatoren für jeden Emittenten ausgedrückt, konkret als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes oder des BIP des jeweiligen Emittenten. Ein Wert von +2% würde beispielsweise bedeuten, dass je 100 US-Dollar Umsatz oder BIP, die der Emittent generiert, ein positiver Nettobeitrag für die Gesellschaft und/oder die Umwelt von 2 US-Dollar erbracht würde. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds ergibt sich aus den Bewertungen aller zulässigen Emittenten im Portfolio des Fonds, die anhand des proprietären Tools von Schroders ermittelt werden. Die Long- und Short-Positionen des Fonds tragen unterschiedlich zum Gesamtwert bei. Long-Positionen mit positivem Wert und Short-Positionen mit negativem Wert tragen beide positiv zum Gesamtwert bei, während Long-Positionen mit negativem Wert und Short-Positionen mit positivem Wert beide dem Gesamtwert abträglich sind.

Der Fonds verwendete Derivate in grossem Umfang, um seine Anlagestrategie umzusetzen und die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen. Long- und Short-Derivatepositionen trugen in unterschiedlicher Weise zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei. Aktien- und Indexderivate (ohne Optionen) werden in derselben Weise wie physische Positionen auf Look-through-Basis bewertet und trugen ebenfalls zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei.

Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums ausserdem mindestens 35% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen.

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2023 und 30. September 2024.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

• *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert für den Bezugszeitraum betrug 7,1%. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird wie oben beschrieben berechnet.

Während des Referenzzeitraums handelte es sich bei den Top-5-Indikatoren im proprietären Tool von Schroders, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitrugen, um folgende:

- Vermiedene Emissionen: geschätzter ökologischer Nutzen durch Unternehmen, die zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft beitragen;
- CO₂-Emissionen Scope 1: die geschätzten Umweltkosten von Scope-1-Treibhausgasemissionen (THG) in Bezug auf den Klimawandel. Scope-1-Emissionen stellen die direkten Emissionen innerhalb des Verantwortungsbereichs eines Unternehmens dar;
- Bereitstellung von Empfängnisverhütungsmitteln: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Herstellung und des Angebots von Empfängnisverhütungsmitteln. Berechnung nach Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz; und
- Höhere Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die ihr Personal über dem örtlichen existenzsichernden Lohn bezahlen (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort;
- Tabak: geschätzte gesellschaftliche Kosten des Rauchens (wird Tabakherstellern zugeordnet). Berechnung nach Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz.

Tabak und Scope 1-CO₂-Emissionen sind gesellschaftliche bzw. ökologische Kosten (und wurden daher negativ bewertet), trugen jedoch positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds bei, da sie Short-Positionen darstellen, und Short-Positionen mit negativen Bewertungen tragen positiv zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei.

Der Fonds verpflichtete sich, mindestens 35% seiner Long-Positionen nachhaltig zu investieren, wobei der Nachhaltigkeitswert jedes Vermögenswerts durch das proprietäre Tool von Schroders definiert wird. Gemäss dieser Vorgabe entfielen während des Bezugszeitraums auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende 63% des Long-Engagements auf nachhaltige Investitionen (bei denen es sich ausschliesslich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden).

Für zusätzlichen Kontext: Der Anlageverwalter investierte während des Referenzzeitraums auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende 31% des Bruttoengagements des Fonds in nachhaltige Investitionen. Dieser Wert entspricht dem prozentualen Anteil nachhaltiger Investitionen am Bruttoengagement des Fonds. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Kauf- als auch Verkaufspositionen, und dieser Wert wird aus Gründen der Kohärenz mit den Berechnungen im nachstehenden Abschnitt über die Vermögensallokation angegeben.

Der Fonds wandte auch bestimmte Ausschlüsse an, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwachte.

• *... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?*

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Nachhaltige Investitionen

Diese Tabelle zeigt den prozentualen Anteil des Vermögens, der in nachhaltige Anlagen investiert wurde, im Jahresvergleich.

Zeitraum	Fonds % (Brutto)	Fonds % (Long)
Okt. 2023 - Sep. 2024	31	63
Okt. 2022 - Sep. 2023	28	55
Okt. 2021 - Sep. 2022	26	52

Nachhaltigkeitswert

Diese Tabelle zeigt die Entwicklung des Nachhaltigkeitswerts des Fonds gegenüber dem Vorjahr

Zeitraum	Fonds (%)
Okt. 2023 - Sep. 2024	7,1
Okt. 2022 - Sep. 2023	9,8
Okt. 2021 - Sep. 2022	8,8

Für den ersten Berichtszeitraum wurde der Prozentsatz der nachhaltigen Investitionen zum Ende des Referenzzeitraums berechnet. Ab Oktober 2022 wurde der Prozentsatz als Durchschnitt auf der Grundlage von Quartalsenddaten berechnet.

• Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

In Bezug auf den nachhaltig investierten Anteil des Long-Portfolios des Fonds wies jede nachhaltige Investition eine positive Nettoauswirkung auf ein oder mehrere ökologische oder soziale Ziele auf, wie anhand des proprietären Tools von Schroders bewertet.

Die Ziele der vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen bestanden unter anderem in:

- Vermiedene Emissionen: geschätzter ökologischer Nutzen durch Unternehmen, die eine systemische oder gesamtwirtschaftliche Verringerung der CO₂-Emissionen ermöglichen.

- Konnektivität: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die durch Telekommunikationsdienste die Vernetzung von Gemeinden ermöglichen und/oder unterstützen; Berechnung im Verhältnis zum geschätzten globalen Nutzen des Zugangs zu globalen Kommunikationstechnologien und Zuweisung dieses Nutzens zu einzelnen Unternehmen auf der Grundlage ihres Anteils an den weltweiten Einnahmen aus Telekommunikations- und Internetkonnektivitätsmärkten, einschliesslich Social-Media-Unternehmen;

- Bereitstellung von Empfängnisverhütungsmitteln: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Herstellung und des Angebots von Empfängnisverhütungsmitteln. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz;

- Höhere Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die ihr Personal über dem örtlichen existenzsichernden Lohn bezahlen (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort; und

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

- Medizin: geschätzter gesellschaftlicher und gesamtwirtschaftlicher Nutzen durch das Angebot von medizinischen Produkten und Dienstleistungen. Zuweisung im Verhältnis zum Stellenwert des betreffenden Unternehmens innerhalb der Wertschöpfungskette des Gesundheitswesens und seinem Gesamtmarktanteil innerhalb des Teilssektors.

Die vorstehenden Beispiele für die Ziele der vom Fonds während des Bezugszeitraums getätigten nachhaltigen Investitionen beruhen auf den wichtigsten Zielen zum jeweiligen Quartalsende. Möglicherweise waren für den Referenzzeitraum weitere Ziele definiert.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

• Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Ansatz des Anlageverwalters, kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel erheblich zu beeinträchtigen, umfasste Folgendes:

Über alle Berichtszeiträume hinweg

- Unternehmensweite Ausschlüsse galten für Schroders-Fonds. Diese betreffen internationale Übereinkommen über Streumunition, Antipersonenminen sowie chemische und biologische Waffen. Eine detaillierte Liste aller ausgeschlossener Unternehmen ist unter <https://www.schroders.com/en/sustainability/activeownership/group-exclusions/> verfügbar.

Weitere Informationen zu allen Ausschlüssen des Fonds finden Sie unter „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen“ auf der Website des Fonds unter <https://www.schroders.com/en-lu/lu/individual/fundcentre>.

Vom 1. Oktober 2023 bis zum 21. November 2023

- Schroders hat am 6. Januar 2020 die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC) unterzeichnet. Der Fonds schloss Unternehmen, die gegen die UNGC-Prinzipien verstossen, aus dem Teil des Portfolios aus, der in nachhaltige Anlagen investiert ist, da Schroders der Auffassung ist, dass solche Unternehmen einem oder mehreren ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlagezielen erheblich schaden. Die Bereiche, die dafür verantwortlich sind, ob ein Emittent Verstößen gegen den UNGC bezichtigt wird, umfassen Aspekte, die von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden, beispielsweise Menschenrechte, Bestechung und Korruption, Arbeitsrechte, Kinderarbeit, Diskriminierung, Gesundheit und Sicherheit sowie Tarifverhandlungen. Die Liste der Unternehmen, die gegen den UNGC verstossen, wurde durch einen Drittanbieter bereitgestellt, und die Compliance mit der Liste wurde mittels unserer automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht. Ausnahmen können gelten, wenn es Nachweise gab, dass das Unternehmen den Verstoss angegangen hat und keinen erheblichen Schaden verursacht, wie vorstehend beschrieben.

- Gegebenenfalls wurden auf Ebene der zugrunde liegenden Strategie, nicht jedoch auf Fondsebene, Unternehmen vom Long-Engagement ausgeschlossen, deren Einnahmen aus Aktivitäten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle, dem Abbau von Kraftwerkskohle und der Kohleverstromung bestimmte Schwellenwerte überschreiten.

Vom 22. November 2023 bis zum 16. Juli 2024

- Der Fonds schliesst Unternehmen von nachhaltigen Investitionen aus, die nach Einschätzung von Schroders gegen eine oder mehrere „globale Normen“ verstossen und dadurch erhebliche ökologische oder soziale Schäden verursacht haben; diese Unternehmen sind auf der von Schroders geführten Liste von Verstößen gegen „globale Normen“ aufgeführt. Bei der Beurteilung, ob ein Unternehmen an einem solchen Verstoss beteiligt war, berücksichtigt Schroders einschlägige Grundsätze wie die im UN Global Compact (UNGC) enthaltenen Prinzipien, die OECD-Leitsätze für

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte. Die Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ kann auf der Grundlage von Bewertungen durch Drittanbieter und eigenen Untersuchungen erstellt werden, wenn dies für eine bestimmte Situation relevant ist.

- Der Fonds schloss Unternehmen, die Umsätze oberhalb bestimmter Schwellenwerte aus Tätigkeiten im Zusammenhang mit Tabak und Kraftwerkskohle erzielen, von nachhaltigen Investitionen aus.

Vom 17. Juli 2024 bis zum 30. September 2024

- Entsprechend der unternehmensweiten Ausschlüsse und ihren Schwellenwerten schloss der Fonds Unternehmen aus seinem Long-Engagement aus, die einen erheblichen Teil ihrer Einnahmen aus der Förderung von Kraftwerkskohle erwirtschaften.

- Der Fonds schloss schrittweise Unternehmen aus seinem Long-Engagement aus, die Umsätze oberhalb bestimmter Schwellenwerte aus Tätigkeiten im Zusammenhang mit Tabak und Kraftwerkskohle erzielen.

- Der Fonds schloss Unternehmen aus seinem Long-Engagement aus, die nach Einschätzung von Schroders gegen eine oder mehrere „globale Normen“ verstossen und dadurch erhebliche ökologische oder soziale Schäden verursacht haben; diese Unternehmen waren auf der von Schroders geführten Liste von Verstößen gegen „globale Normen“ aufgeführt. Bei der Beurteilung, ob ein Unternehmen an einem solchen Verstoß beteiligt war, berücksichtigte Schroders einschlägige Grundsätze wie die UNGC-Grundsätze (UN Global Compact), die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte. Die Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ kann auf der Grundlage von Bewertungen durch Drittanbieter und eigenen Untersuchungen erstellt werden, wenn dies für eine bestimmte Situation relevant ist.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei der Identifizierung erheblicher Beeinträchtigungen umfasste der Ansatz von Schroders zur Berücksichtigung der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, PAI) sowohl eine quantitative als auch eine qualitative Bewertung. Unternehmen, in die investiert wird, und von denen angenommen wird, dass sie die quantitativen Schwellenwerte nicht erfüllen, wären im Allgemeinen ausgeschlossen worden, es sei denn, die Daten wurden im Einzelfall als nicht repräsentativ für die Leistung eines Unternehmens in dem betreffenden Bereich angesehen. Wurde die Festlegung quantitativer Schwellenwerte nicht für angemessen oder machbar erachtet, so hat der Anlageverwalter gegebenenfalls entsprechend den im „Engagement Blueprint“ und/oder in den Abstimmungsrichtlinien von Schroders dokumentierten Prioritäten mitgewirkt.

Dieser Rahmen unterliegt einer kontinuierlichen Überprüfung, insbesondere angesichts der Entwicklung der Verfügbarkeit und Qualität der Daten.

Unser Ansatz umfasste:

1. Quantitativ: hierzu gehörten Indikatoren, für die bestimmte Schwellenwerte festgelegt wurden:

- Durch die Anwendung von Ausschlüssen. Dieser Ansatz ist relevant für PAI 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) für das Long-Engagement des Fonds und PAI 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) für das Long- und Short-Engagement des Fonds. Darüber hinaus wurden die folgenden PAIs im Rahmen des Ausschlusses gemäss der von Schroders geführten Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ bewertet (die darauf abzielt, Unternehmen auszuschliessen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen), die für das Long-Engagement des Fonds angewendet wird: PAI 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI 8 (Emissionen in Wasser), PAI 9 (Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle), PAI 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung für multinationale Unternehmen), PAI 11 (Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und freiwillig) und PAI 3 in Tabelle 3 (Anzahl identifizierter Fälle von schweren Menschenrechtsfragen und -vorfällen).

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

– Über die Anwendung einer Warnsystemkennzeichnung, wenn der oder die relevanten Indikatoren einen Schwellenwert überschritt. Diese quantitativen Schwellenwerte zur Beurteilung erheblicher Beeinträchtigungen werden von unserem Team für nachhaltige Investitionen zentral festgelegt und systematisch überwacht. Dieser Ansatz gilt für Indikatoren, bei denen wir die Grundgesamtheit in Beeinträchtigungsgruppen unterteilt haben, um einen Schwellenwert festzulegen, wie z. B. die kohlenstoffbezogenen PAI-Kennzahlen, PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fussabdruck) und der freiwillige PAI 4 in Tabelle 2 (Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen). PAI 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) funktioniert ähnlich, aber der Schwellenwert basiert auf einer Umsatzkennzahl. Ein Schwellenwert für PAI 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren) wird auf der Grundlage der obengenannten CO₂-Kennzahlen festgelegt. Ein ähnlicher Ansatz wurde für PAI 15 (THG-Emissionsintensität) gewählt. PAI 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen) funktioniert ebenfalls auf die gleiche Weise, basiert jedoch auf der Verfügbarkeit von Daten zu sozialen Verstößen. Im Rahmen dieses Prozesses wurde/n der/die betreffende(n) Emittent(en), bei dem/denen davon ausgegangen wird, dass er/sie die quantitativen Schwellenwerte nicht erfüllte/n, dem Anlageverwalter zur Prüfung vorgelegt. Dessen Reaktion konnte darin bestehen, die Beteiligung(en) zu verkaufen oder die Position beizubehalten, wenn die Daten im Einzelfall als nicht repräsentativ für die Leistung eines Unternehmens in dem betreffenden Bereich angesehen wurden. Unternehmen, in die investiert wird und von denen angenommen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, wurden aus dem Long-Engagement des Fonds ausgeschlossen.

2. Qualitativ: Dies schloss PAI-Indikatoren ein, bei denen Schroders der Ansicht war, dass die verfügbaren Daten uns nicht in die Lage versetzten, eine quantitative Entscheidung darüber zu treffen, ob eine erhebliche Beeinträchtigung vorlag, die den Ausschluss einer Investition rechtfertigte. In solchen Fällen arbeitete der Anlageverwalter, wo immer möglich, mit dem oder den Unternehmen zusammen, die er hielt, und zwar in Übereinstimmung mit den Prioritäten, die im Engagement Blueprint von Schroders und/oder in den Abstimmungsrichtlinien dokumentiert sind. Dieser Ansatz gilt für Indikatoren wie PAI 12 (Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle) und PAI 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen), bei denen wir aktiv wurden und unsere Stimmrechte nutzen konnten, wenn wir dies für angemessen hielten. Sowohl die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen als auch die Offenlegung von Informationen zum geschlechtsspezifischen Verdienstgefälle sind in unserem Engagement Blueprint festgehalten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anteil nachhaltiger Investitionen steht im Einklang mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

Unternehmen auf der von Schroders geführten Liste der Verstösse gegen „globale Normen“ wurden nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft. Bei der Entscheidung, ob ein Unternehmen in eine solche Liste aufgenommen werden soll, berücksichtigte Schroders neben anderen einschlägigen Grundsätzen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte. Die Liste der Verstösse gegen „globale Normen“ beruhte auf Informationen von Drittanbietern und, wo relevant, auf eigenen Untersuchungen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Vom 1. Oktober 2023 bis zum 16. Juli 2024

Der Ansatz des Anlageverwalters zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsfaktoren beinhaltete die Einstufung der Indikatoren in drei Kategorien:

1. Festlegung von Schwellenwerten: Hierzu zählten sehr eindeutige Schwellenwerte dafür, ob eine Anlage als „nachhaltige Investition“ angesehen wird. Beispielsweise PAI 10 zu Verletzungen von UNGC-Prinzipien.
2. Aktive Beteiligung (indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien): Dabei handelte es sich um Indikatoren, für die wir einen Plan hatten, um uns bei der zugrunde liegenden Beteiligung zu engagieren, wie in dem Dokument der Schroders-Gruppe dargelegt, in dem unser Ansatz in Bezug auf die aktive Beteiligung beschrieben wird. Zum Beispiel PAI 1, 2 und 3 zu Treibhausgasemissionen und PAI 13 zur Geschlechterdiversität im Verwaltungsrat.
3. Verbesserung der Datenlage (indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien): Hierzu zählten Indikatoren, bei denen wir die Datenlage für zu spärlich hielten, um zu handeln, und bei denen wir uns in erster Linie darauf konzentrierten, auf die zugrunde liegenden Unternehmen einzuwirken, um die Berichterstattung zu verbessern. Zum Beispiel PAI 7 zur biologischen Vielfalt, PAI 9 zum Anteil gefährlicher Abfälle und PAI 12 zum geschlechtsspezifischen Lohngefälle.

Vom 17. Juli 2024 bis zum 30. September 2024

Der Fonds verteilte sein Vermögen auf mehrere zugrunde liegende Strategien. Einige PAIs wurden gegebenenfalls auf Fondsebene berücksichtigt, andere PAIs auf der Ebene der zugrunde liegenden Strategien durch den jeweiligen Anlageverwalter. Weitere Einzelheiten dazu, wie diese während des Bezugszeitraums berücksichtigt wurden, sind nachstehend aufgeführt.

Einige PAIs wurden im Rahmen der Vorinvestitionsprüfung durch die Anwendung von Ausschlüssen berücksichtigt. Dazu zählten:

- Umstrittene Waffen: PAI 14 (Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)) – auf Long- und Short-Engagements angewandt
- Von Schroders geführte Liste mit Verstößen gegen „globale Normen“, die Folgendes abdeckt: PAI 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI 8 (Emissionen in Wasser), PAI 9 (Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle), PAI 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen), PAI 11 (Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen) und PAI 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen) – angewendet auf Long-Engagements.
- Unternehmen, die Umsätze oberhalb bestimmter Schwellenwerte aus Tätigkeiten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle erzielen: PAI 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) – auf Long-Engagements auf Ebene des Long-Engagements angewandt

Die Einhaltung dieser Schwellenwerte wurde über den Portfolio-Compliance-Rahmen des Anlageverwalters überwacht.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Andere PAIs wurden im Rahmen der aktiven Eigentümerschaft berücksichtigt, die indirekt über die zugrunde liegenden Anlageverwalter erfolgte. Gegebenenfalls wurden auf der Grundlage der zugrunde liegenden Strategien und des Anlageprozesses des jeweiligen Anlageverwalters PAIs nach der Anlage im Rahmen von Engagement-Aktivitäten gemäss dem Ansatz und den Zielsetzungen des Engagement Blueprint von Schroders berücksichtigt. Zu den Schwerpunktthemen, die in unserem Engagement Blueprint berücksichtigt werden, gehören:

- Klimawandel
- Naturkapital und Biodiversität
- Menschenrechte
- Humankapitalmanagement
- Diversität und Inklusion
- Corporate Governance

Beispiele für mit diesem Ansatz erfasste PAIs sind etwa PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO2-Fussabdruck), PAI 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) und PAI 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen).

Nachstehend sind die Engagement-Aktivitäten des Fonds im Referenzzeitraum zusammengefasst, einschliesslich des jeweiligen Themas des Engagements

Engagement-Thema	Anzahl der Emittenten
Klimawandel	53
Corporate Governance	35
Menschenrechte	10
Humankapitalmanagement	10
Naturkapital und Biodiversität	10
Diversität und Inklusion	8

Unser Ansatz unterliegt einer laufenden Überprüfung, insbesondere in Anbetracht der sich verbessernden Verfügbarkeit und Qualität der Daten.



Welche waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 grössten Investitionen nach Nettoengagement (in % des NIW) während des Bezugszeitraums waren:

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
1. Okt. 2023 bis 30. Sep. 2024

Grösste Investitionen	Sektor	% des Vermögens (Netto)	Land
SAMSUNG ELECTRONICS	Informationstechnologie	1,93	Korea (Süd),
MEDIATEK	Informationstechnologie	1,63	Republik Taiwan (Republik China)
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY	Industrie	1,41	China
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD LJUBLJANA	Finanzen	1,36	Slowenien
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Informationstechnologie	1,27	Taiwan (Republik China)
SHENZHOU INTERNATIONAL	Zyklische Konsumgüter	1,18	China
ALPHABET	Kommunikationsdienstleistungen	1,09	USA
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	Finanzen	1,08	Südkorea, Republik
TRIP.COM GROUP	Zyklische Konsumgüter	1,05	China
SAP	Informationstechnologie	1,02	Deutschland
DBS GROUP HOLDINGS	Finanzen	1,01	Dänemark
SCHNEIDER ELECTRIC	Industrie	1,01	Frankreich
RELX	Industrie	0,97	Vereinigtes Königreich
RIO TINTO	Grundstoffe	0,96	Vereinigtes Königreich
BHP GROUP	Grundstoffe	0,95	Australien

Die vorstehende Liste stellt den Durchschnitt des Nettoengagements des Fonds in % des NIW an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Die Engagements wurden, soweit möglich, auf Look-through-Basis für Indexfutures, Indexoptionen, Total-Return-Swap-Positionen (TRS) und Differenzkontrakt-Baskets (CFD) zur Verfügung gestellt. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet.

Die Daten zu den grössten Investitionen und dem prozentualen Anteil am NIW stammen aus dem Schroders Investment Book of Record (IBoR). Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten grössten Investitionen und prozentualen Anteile am NIW sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu den grössten Investitionen und Prozentsätzen des NIW voneinander abweichen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation definiert den Anteil der Anlagen in bestimmten Vermögenswerten.

• Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Anlagen des Fonds, die genutzt werden, um seine ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst den Anteil des Fondsvermögens, der zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale eingesetzt wird. Dieser Anteil beträgt 98% des Bruttoengagements. Der Fonds erzielte dauerhaft einen positiven absoluten

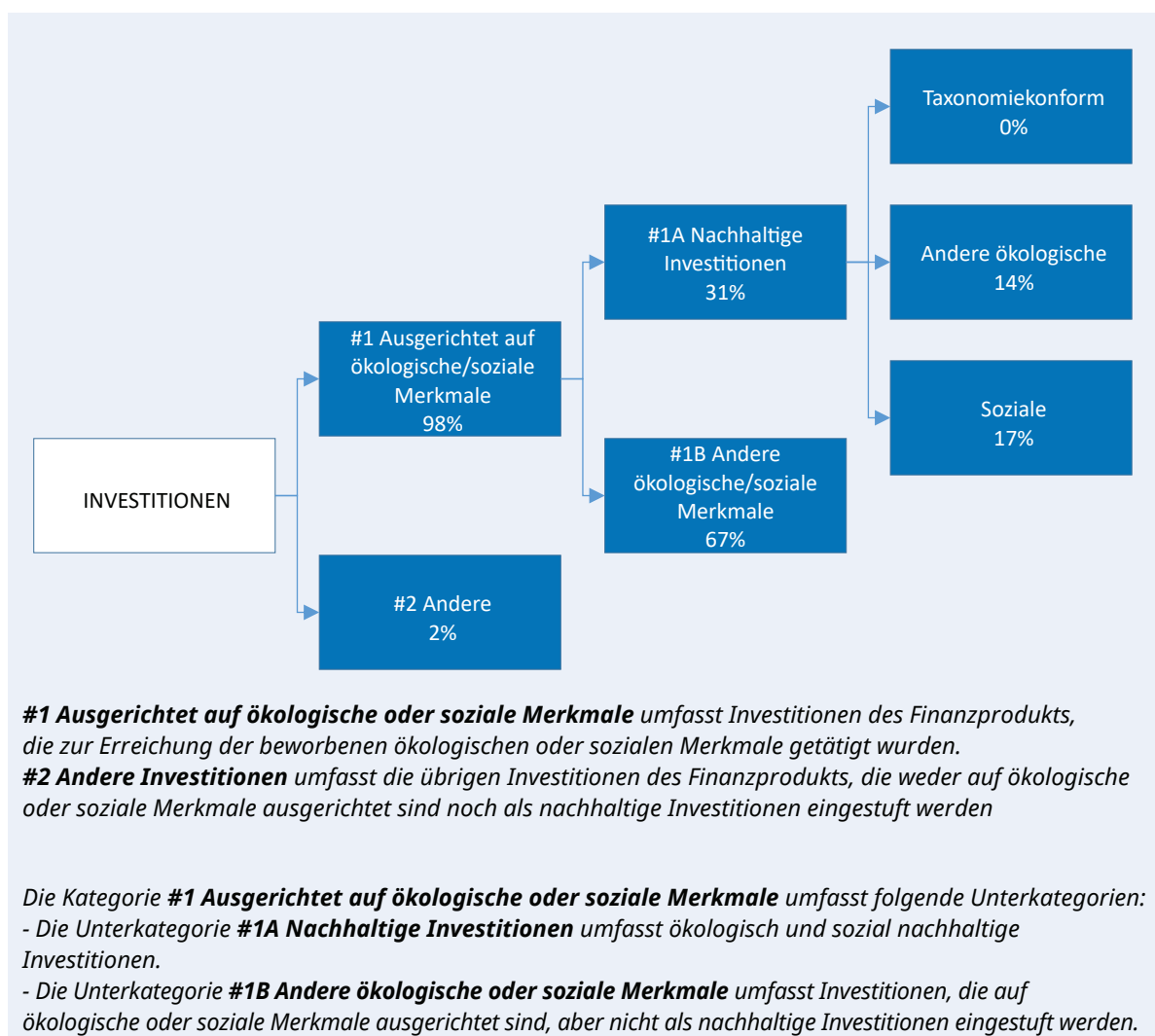
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Nachhaltigkeitswert, und somit wurden die Investitionen (Long- und Short-Positionen) des Fonds, die durch das proprietäre Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden, unter #1 einbezogen, wenn sie Einfluss auf den Nachhaltigkeitswert des Fonds hatten (unabhängig davon, ob eine jeweilige Einzelinvestition einen positiven oder einen negativen Wert aufwies). Long-Positionen mit positiven Bewertungen und Short-Positionen mit negativen Bewertungen trugen beide positiv zur Gesamtbewertung bei, während Long-Positionen mit negativen Bewertungen und Short-Positionen mit positiven Bewertungen beide die Gesamtbewertung beeinträchtigten. Der unter #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale angegebene Prozentsatz bezieht sich auf den Durchschnitt des Bezugszeitraums auf der Grundlage der Quartalsenddaten. Ebenfalls in #1 enthalten ist der Anteil des Bruttoengagements, der in nachhaltige Anlagen investiert wurde, wie in #1A angegeben.

Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums 31% seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen. Dieser Prozentsatz entspricht dem Durchschnitt der Quartalsenddaten im Referenzzeitraum. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Long- als auch Short-Positionen, während die Prozentangabe nur Long-Positionen umfasst, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. 14% davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 17% in nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel investiert. Der Fonds verpflichtete sich jedoch, mindestens 35% seines Long-Engagements in nachhaltige Anlagen zu investieren. Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums 63% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen. 28% davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 34% in nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel investiert. Die Summe des Prozentsatzes nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel und des Prozentsatzes nachhaltiger Investitionen mit einem sozialen Ziel ergibt aufgrund von Rundungen möglicherweise nicht den Gesamtprozentsatz nachhaltiger Investitionen. In Bezug auf den nachhaltig investierten Anteil des Fondsportfolios wies jede nachhaltige Investition eine positive Nettoauswirkung auf ein oder mehrere ökologische oder soziale Ziele auf, wie anhand des proprietären Tools von Schroders bewertet. Mit Ausnahme von grünen oder sozialen Anleihen, die grundsätzlich als Investitionen mit ökologischem bzw. sozialem Ziel eingestuft werden, hängt die Einstufung von nachhaltigen Investitionen als Investitionen mit einem ökologischen oder sozialen Ziel davon ab, ob der betreffende Emittent laut der Daten des proprietären Tools von Schroders bessere Umweltindikatoren oder soziale Indikatoren aufweist als seine Vergleichsgruppe. In beiden Fällen berücksichtigen die Indikatoren die Elemente „Kosten“ und „Nutzen“.

#2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht anhand des proprietären Nachhaltigkeitstools von Schroders bewertet werden und daher nicht zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitragen. Barmittel und Barmitteläquivalente sind von #2 Andere Investitionen aufgrund der Long/Short-Natur der Anlagestrategie des Fonds ausgeschlossen.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



Die oben angegebenen Prozentsätze werden aus Gründen der Einheitlichkeit als Anteil des Bruttoengagements berechnet. Der Fonds hat sich jedoch verpflichtet, mindestens 35% seines Long-Engagements nachhaltig zu investieren, und während des Referenzzeitraums entfielen 63% der Long-Positionen des Fonds auf nachhaltige Investitionen.

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet. Diese Verrechnung erfolgte vor der Einstufung als Long- oder Short-Engagement und vor der Berechnung des Bruttoengagements.

• In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden in den folgenden Wirtschaftssektoren Investitionen auf Basis des Brutto- und Nettoengagements (in% des NIW) getätigt:

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Sektor	Teilsektor	% des Vermögens (Netto)	% des Vermögens (Brutto)
Kommunikationsdienstleistungen	Medien und Unterhaltung	2,14	11,69
Kommunikationsdienstleistungen	Telekommunikationsdienstleistungen	-1,01	5,85
Zyklische Konsumgüter	Automobile und Autoteile	-2,28	8,62
Zyklische Konsumgüter	Zyklische Konsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	-3,65	11,85
Zyklische Konsumgüter	Gebrauchsgüter und Bekleidung	3,82	12,74
Zyklische Konsumgüter	Verbraucherdienstleistungen	0,69	12,37
Basiskonsumgüter	Basiskonsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	-0,38	6,63
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel, Getränke und Tabakwaren	-3,28	9,61
Basiskonsumgüter	Haushalts- und Körperpflegeprodukte	-0,51	3,42
Energie	Energie	-1,15	10,85
Finanzen	Banken	-1,57	35,91
Finanzen	Finanzdienstleistungen	0,03	16,09
Finanzen	Versicherung	0,13	11,16
Gesundheitswesen	Geräte und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen	0,74	8,41
Gesundheitswesen	Pharmazeutika, Biotechnologie & Life Sciences	-1,04	10,27
Inhaltsverzeichnis	Inhaltsverzeichnis	1,09	5,80
Industrie	Investitionsgüter	3,71	38,77
Industrie	Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen	0,37	8,07
Industrie	Transport	-0,59	9,62
Informationstechnologie	Halbleiter und Halbleiterausrüstung	1,82	14,14
Informationstechnologie	Software und softwarebezogene Dienstleistungen	2,64	12,86
Informationstechnologie	Technologie-Hardware und Ausrüstung	2,15	18,22
Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	1,56	1,56
Grundstoffe	Grundstoffe	-0,58	26,62
Immobilien	Aktien - Real Estate Investment Trusts (REITs)	-0,78	3,16
Immobilien	Immobilienbewirtschaftung und -entwicklung	-0,29	6,66
Versorger	Versorger	-3,15	6,63

Die obige Liste basiert auf dem durchschnittlichen Brutto- und Nettoengagement des Fonds in % des NIW an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums.

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet.

Die obigen Angaben zu den auf die Sektoren entfallenden Prozentanteilen des NIW sind dem Schroders Investment Book of Record (IBOR) entnommen. Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten Prozentanteile des NIW an den Sektoren sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu Prozentanteilen des NIW an einzelnen Sektoren voneinander abweichen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Es gab keine definierte Mindest-Taxonomieausrichtung der Anlagen des Fonds (einschliesslich Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomieausrichtung der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und wird mit 0% des Fondsportfolios angegeben.

• **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- ☐ Ja:
- ☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Aktivitäten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

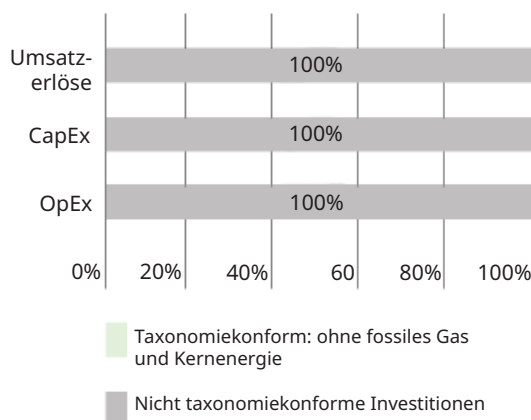
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

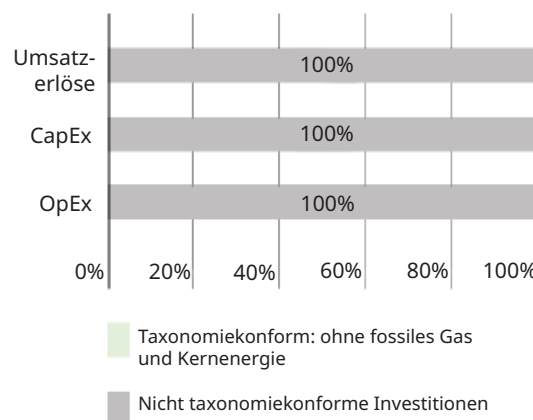
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt x% der Gesamtinvestitionen wieder²

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

²Da keine Taxonomiekonformität besteht, hat der Ausschluss von Staatsanleihen keine Auswirkungen auf das Diagramm (d. h. der Prozentsatz der Investitionen, die der Taxonomie entsprechen, bleibt bei 0%) und die Verwaltungsgesellschaft ist daher der Ansicht, dass es nicht notwendig ist, diese Information anzugeben.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

• **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

• **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Diese Frage ist nicht relevant.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Während des Referenzzeitraums und auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende investierte der Fonds 14% seines Bruttoengagements in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, die nicht mit der Taxonomie konform waren. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Vereinheitlichung mit der oben im Abschnitt „Vermögensallokation“ angegebenen Berechnungsgrundlage aufgeführt. Der Fonds investierte 28% seines Long-Engagements in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, die nicht mit der Taxonomie konform waren.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Während des Bezugszeitraums und auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende investierte der Fonds 17% seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Vereinheitlichung mit der oben im Abschnitt „Vermögensallokation“ angegebenen Berechnungsgrundlage aufgeführt. Der Fonds investierte 34% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht anhand des proprietären Nachhaltigkeitstools von Schroders bewertet werden und daher nicht zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitragen. Barmittel und Barmitteläquivalente sind von #2 Andere Investitionen aufgrund der Long/Short-Natur der Anlagestrategie des Fonds ausgeschlossen.

Mindestschutzregelungen wurden gegebenenfalls auf Geldmarktinstrumente und Optionen angewandt, die zur Risikominderung (Absicherung) verwendet wurden, oder auf andere Anlagen, indem (gegebenenfalls) Anlagen in Gegenparteien eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken) verbunden oder dort engagiert waren. Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Länder berücksichtigt; dabei wird auf eine Reihe von öffentlichen Erklärungen, Indizes und globale Staatsführungsindikatoren Bezug genommen, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der britischen Regierung, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NRO) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Kontrahenten durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft und die Zulassung eines neuen Kontrahenten basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld eines jeden Kontrahenten und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems sowie dessen aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein firmeneigenes Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Kontrahenten unterstützt.

Das Kreditrisikoteam von Schroders überwachte die Gegenparteien, und soweit während des Bezugszeitraums Gegenparteien gemäss unseren Richtlinien und Compliance-Anforderungen aus der genehmigten Liste für alle Fonds entfernt wurden, waren diese Kontrahenten ab dem Zeitpunkt ihrer Entfernung in Bezug auf relevante Anlagen nicht mehr für den Fonds zugelassen.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden die folgenden Massnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen:

- Der Anlageverwalter wandte bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien an;
- Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Auswahl der Vermögenswerte den Nachhaltigkeitswert des Fonds;
- Während des gesamten Berichtszeitraums wurde eine Bewertung der guten Unternehmensführung durchgeführt; und
- Der Anlageverwalter setzte (auch indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien) Engagement-Aktivitäten in Bezug auf mindestens eines der sechs vorrangigen Themen um, die in unserem Engagement Blueprint (Link <https://mybrand.schroders.com/m/3222ea4ed44a1f2c/original/schroders-engagement-blueprint.pdf>) definiert sind. Die Engagement-Aktivitäten des Fonds mit Angaben zur Anzahl der Emittenten, mit denen zusammengearbeitet wurde, und zu den entsprechenden Themen sind oben in der Antwort auf die Frage „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“ zusammengefasst. Durch unsere Engagement-Aktivitäten bauen wir Beziehungen auf und führen einen wechselseitigen Dialog mit den Unternehmen, in die wir investieren. Wir wollen damit Veränderungen vorantreiben, die den Wert unserer Investitionen schützen und steigern.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Referenzbenchmarks sind Indizes, die messen, ob Finanzprodukte die ökologischen oder sozialen Merkmale, auf die sie abzielen, tatsächlich fördern.

Es wurde kein Index als Benchmark festgelegt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

• *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

• *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

• *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

• *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Wichtige Hinweise

Die in diesem Anhang enthaltenen Angaben dienen der Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Offenlegungspflichten von Schroder Investment Management (Europe) S.A. und sollten nur zu Informationszwecken verwendet werden. Das Material soll kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten darstellen. Das Material soll keine Rechnungslegungs-, Rechts- oder Steuerberatung oder Anlageempfehlung darstellen und sollte nicht entsprechend verwendet werden. Die hierin enthaltenen Informationen werden als zuverlässig erachtet, Schroders übernimmt jedoch keine Gewähr für deren Vollständigkeit oder Richtigkeit und kann keine Verantwortung für Irrtümer in Bezug auf Fakten oder Meinungen übernehmen. Individuelle Anlage- und/oder strategische Entscheidungen sollten nicht auf der Grundlage der in diesen Angaben enthaltenen Ansichten und Informationen getroffen werden. Schroders hat in diesen Angaben eigene Ansichten zum Ausdruck gebracht, die sich ändern können.

Bestimmte hierin enthaltene Informationen (die „Informationen“) stammen von bzw. sind urheberrechtlich geschützt von MSCI Inc., MSCI ESG Research LLC oder ihren verbundenen Unternehmen („MSCI“) oder Informationsanbietern (zusammen die „MSCI-Parteien“) und können zur Berechnung von Bewertungen, Signalen oder anderen Indikatoren verwendet worden sein. Die Informationen sind nur für den internen Gebrauch bestimmt und dürfen ohne vorherige schriftliche Genehmigung weder ganz noch teilweise vervielfältigt oder verbreitet werden. Die Informationen dürfen nicht für ein Angebot zum Kauf oder Verkauf oder eine Werbung oder Empfehlung von Wertpapieren, Finanzinstrumenten oder -produkten, Handelsstrategien oder Indizes verwendet werden und sind auch nicht als Hinweis oder Garantie für eine zukünftige Wertentwicklung zu verstehen. Einige Fonds können auf MSCI-Indizes basieren oder an diese gekoppelt sein, und MSCI kann auf der Grundlage des verwalteten Vermögens des Fonds oder anderer Kennzahlen vergütet werden. MSCI hat eine Informationsbarriere zwischen Indexanalyse und bestimmten Informationen geschaffen. Die Informationen selbst dürfen nicht dazu verwendet werden, zu bestimmen, welche Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen sind oder wann sie gekauft oder verkauft werden sollten. Die Informationen werden ohne Mängelgewähr bereitgestellt und der Nutzer übernimmt das volle Risiko der Nutzung der Informationen, die er vornimmt oder zulässt. Keine MSCI-Partei garantiert die Ursprünglichkeit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der Informationen und jede Partei lehnt ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien ab. Keine MSCI-Partei haftet für Fehler oder Auslassungen im Zusammenhang mit hierin enthaltenen Informationen oder für direkte, indirekte oder spezielle Schäden, Strafschadenersatz, Folgeschäden oder sonstige Schäden (einschliesslich entgangener Gewinne), selbst wenn sie auf die Möglichkeit solcher Schäden hingewiesen wurde.

Anhang IV – Fondsperformance (ungeprüft) für das Kalenderjahr 2023*

	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	Schroder GAIA Oaktree Credit	Schroder GAIA SEG US Equity	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	7,41%	(9,68%)	15,99%	23,06%	12,69%	2,24%	-	-	11,89%	-	(1,45%)
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	(12,94%)	-	18,85%	-	(1,77%)	-	-	8,14%	-	(5,33%)
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	(11,27%)	13,62%	21,16%	-	0,13%	-	-	10,07%	-	(3,44%)
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	14,26%	-	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	13,78%	-	-	0,45%	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	21,71%	-	0,80%	-	-	-	-	(2,83%)
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	15,07%	-	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	10,22%	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	22,73%	12,13%	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	14,48%	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-	13,77%	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	8,86%	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	11,08%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-	13,64%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	8,91%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	11,05%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	12,72%	-	-	-	-
Klasse C Thes.	8,05%	(9,12%)	16,44%	23,61%	13,53%	3,32%	14,01%	-	12,42%	12,47%	(0,66%)
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	4,35%	-	-	-	-	-	-	-	-	14,09%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	(12,41%)	11,80%	19,75%	-	(0,79%)	9,40%	-	8,32%	10,23%	(4,59%)
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	(10,76%)	14,05%	22,05%	-	1,20%	11,61%	-	10,36%	11,74%	(2,69%)
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	(9,42%)	15,73%	23,28%	15,12%	2,73%	13,26%	-	11,80%	12,40%	(1,23%)
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	22,19%	-	2,22%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	1,87%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	15,93%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	13,53%	-	14,19%	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	9,47%	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	11,63%	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	11,04%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	(9,39%)	-	-	-	-	13,30%	-	11,95%	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	3,65%	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-4,60%
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-2,67%
Klasse E Thes.	-	(9,11%)	-	23,75%	13,47%	3,71%	14,19%	-	13,16%	-	-0,18%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	20,03%	-	(0,30%)	9,57%	-	-	-	-4,11%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	(10,74%)	-	22,32%	-	1,60%	11,79%	-	10,93%	-	-2,17%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	3,15%	13,42%	-	-	-	-0,74%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	22,36%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-	14,29%	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	9,65%	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	11,80%	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	(9,39%)	-	-	-	-	13,47%	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	16,04%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	11,45%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	13,66%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	16,04%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	14,38%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	11,47%	-	17,87%	-	-	4,59%	15,05%	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	13,19%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	15,52%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	11,60%	-	-	(1,06%)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	16,50%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	11,89%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	14,13%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	14,33%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	6,83%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	8,27%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung. Diese Performanceangaben berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Aktien anfallen.

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

Anhang IV – Fondsperformance (ungeprüft) für das Kalenderjahr 2023* (Forts.)

	Schröder GAIA Asian Equity Long Short		Schröder GAIA BlueTrend	Schröder GAIA Cat Bond	Schröder GAIA Contour Tech Equity	Schröder GAIA Egerton Equity	Schröder GAIA Helix	Schröder GAIA Oaktree Credit	Schröder GAIA SEG US Equity	Schröder GAIA Sirios US Equity	Schröder GAIA Two Sigma Diversified	Schröder GAIA Wellington Pagosa
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	3,06%	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12,32%	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	10,20%	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11,68%	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	(10,74%)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	(9,55%)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	(10,38%)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	11,81%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	13,79%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	7,09%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	6,52%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-	-	7,14%	-	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	4,67%	-	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-	-	7,73%	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	3,16%	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	5,24%	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	6,67%	-	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-	-	7,49%	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	3,25%	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	4,97%	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	6,45%	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	5,55%	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	5,34%	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	-	4,22%	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	2,04%	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	3,43%	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	-	13,65%	-	-	-	12,41%	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	1,84%	-	-	10,53%	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	16,79%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	12,14%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	14,42%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	16,34%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	11,67%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	13,92%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	17,53%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	12,84%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	15,12%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	16,77%	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung. Diese Performanceangaben berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Aktien anfallen.
Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen.

Anhang IV – Fondsperformance (ungeprüft) für drei Kalenderjahre bis zum 31. Dezember 2023*

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA SEG US Equity	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	19,92%	15,29%	2,46%	4,61%	(4,09%)	-	17,54%	-	7,53%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	13,91%	-	(5,74%)	-	(10,72%)	-	9,47%	-	0,40%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	16,20%	-	(2,44%)	-	(8,65%)	-	11,76%	-	2,68%
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	7,78%	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	(0,16%)	-	(4,84%)	-	-	-	5,88%
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	10,37%	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	1,42%	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	1,62%	3,14%	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	8,82%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	21,58%	16,66%	4,52%	6,85%	(0,33%)	-	19,39%	21,81%	9,58%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	40,05%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	15,76%	7,96%	(3,20%)	-	(7,41%)	-	11,29%	15,22%	2,21%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	17,98%	11,18%	(0,15%)	-	(5,58%)	-	13,80%	17,61%	4,58%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	21,74%	15,68%	2,97%	10,08%	(2,03%)	-	17,30%	20,78%	8,41%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	0,72%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	(1,99%)	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	12,84%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	6,63%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	3,51%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	21,91%	-	-	-	-	-	17,37%	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	0,13%	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	2,03%
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	4,96%
Klasse E Thes.	21,18%	-	5,75%	6,87%	0,94%	-	20,90%	-	11,79%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	(1,25%)	-	(6,53%)	-	-	-	4,19%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	17,52%	-	1,08%	-	(4,09%)	-	14,95%	-	6,65%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	(0,39%)	-	-	-	10,49%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	1,62%	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	21,18%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	15,47%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	6,96%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	9,93%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	15,47%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	13,52%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	21,05%	-	-	4,45%	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	12,12%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	15,38%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	11,76%	-	-	(3,62%)	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	16,85%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	8,23%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	11,32%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	12,85%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	(1,36%)	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	20,44%	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	14,02%	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	16,39%	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	20,89%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	12,18%	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	5,99%	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	13,91%	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	4,47%	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	7,66%	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	10,48%	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	13,15%	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	6,62%	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	10,41%	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	7,59%	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	7,04%	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	7,14%	-	-	19,59%	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	(3,26%)	-	13,43%	-	-

* Bitte beachten Sie, dass Schroder GAIA Asian Equity Long Short und Schroder GAIA Oaktree Credit nicht in die obige Tabelle aufgenommen wurden, da die Teilfonds nicht während des gesamten Zeitraums von drei Jahren bis zum 31. Dezember 2023 aktiv waren.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung. Diese Performanceangaben berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Aktien anfallen.

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



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

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

GAIA 30. September 2024 CHDE