



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Geprüfter Jahresbericht

30. September 2020

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

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

Inhalt

Schroder GAIA	5
Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland	6
Verwaltungsrat	7
Verwaltung	8
Bericht des Verwaltungsrats	9
Bericht des Anlageverwalters	10
Prüfbericht	12
Nettovermögensaufstellung	15
Ertrags- und Aufwandsrechnung	25
Veränderung des Nettovermögens	27
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	29
Anlageportfolio	33
Schroder GAIA BlueTrend	33
Schroder GAIA Cat Bond	33
Schroder GAIA Contour Tech Equity	37
Schroder GAIA Egerton Equity	38
Schroder GAIA Helix	39
Schroder GAIA Sirios US Equity	42
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	44
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	45
Schroder GAIA Wellington Pagosa	46
Anmerkungen zum Abschluss	59
Gesamtkostenquote („TER“)	129
Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)	131
Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	133

Die Gesellschaft

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

Dieser Bericht betrifft das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2019 bis zum 30. September 2020. Der Jahresabschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Der letzte Termin, an dem die Anteilkurse berechnet wurden, war der 30. September 2020, der letzte Arbeitstag im Berichtsjahr. Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen neu Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die „Teilfonds“).

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

Schroders ist eine FATCA-konforme Organisation. Die FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft und ihre GIIN lauten wie folgt: FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft: FFI; Sponsoring-Gesellschaft: Schroder Investment Management (Europe) S.A.; GIIN der Sponsoring-Gesellschaft: 4R1MT7.00000.SP.442.

Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

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

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland

Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

UBS Deutschland AG
OpernTurm
Bockenheimer Landstraße 2-4
D-60306 Frankfurt am Main

Weitere Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

Schroder Investment Management GmbH
Taunustor 1
D-60310 Frankfurt am Main

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

Wertpapierbestandsveränderungen

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

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

Head of Schroders GAIA

Vaults 13-15
Valletta Waterfront
FRN 1914
Malta

Andere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche**

Head of Iberian Business

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

- **Mike Champion**

Head of Product Development

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

12, rue de la Sapinière, 8150 Bridel
Großherzogtum Luxemburg

- **Daniel de Fernando Garcia¹**

Independent Director

Serrano 1, 28001 Madrid
Spanien

- **Bernard Herman**

Independent Director

11-13, rue Jean Fischbach, 3372 Leudelange
Großherzogtum Luxemburg

- **Achim Küssner**

Country Head Germany, Austria & CEE

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

- **Hugh Mullan²**

Independent Director

5, rue Hohenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

- **Neil Walton**

Head of Investment Solutions

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

¹ Das Verwaltungsratsmandat von Daniel de Fernando Garcia endete im Berichtszeitraum am 26. März 2020.

² Hugh Mullan wurde zum 26. März 2020 in den Verwaltungsrat berufen.

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Registerstelle und Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptzahlstelle und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg

16, boulevard d'Avranches, 1160 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Depotbank und Fondsverwalter

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

80, route d'Esch, 1470 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

BennBridge Ltd.

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

Contour Asset Management, LLC

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

USA

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Egerton Capital (UK) LLP

Stratton House, 5 Stratton Street, London W1J 8LA

Vereinigtes Königreich

Schroder GAIA Egerton Equity

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

- Egerton Capital (US), LP.

Nuveen Asset Management, LLC

333 West Wacker Drive, Chicago, IL 60606

USA

Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*

Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*

Schroder Investment Management Limited

1 London Wall Place, London EC2Y 5AU

Vereinigtes Königreich

Schroder GAIA Helix

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

- BennBridge Ltd.

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Central 2, CH-8001 Zürich, Schweiz

Schroder GAIA Cat Bond

Sirios Capital Management LP

One International Place, Boston, MA 02110, USA

Schroder GAIA Sirios US Equity

Systematica Investments Limited

29 Esplanade, St Helier JE2 3QA, Jersey

Schroder GAIA BlueTrend

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

- Systematica Investments UK LLP,

- Systematica Investments Jersey Limited,

- Systematica Investments GP Limited, Niederlassung Genf, und

- Systematica Investments Singapore PTE.

Two Sigma Advisers LP

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

USA

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

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 Unteranlageverwalter für den Schroder GAIA Wellington Pagosa bestellt:

- Wellington Management Company LLP.

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

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 vor.

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

Zum 30. September 2020 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 4.869.786.470 EUR, was im Vergleich zu 5.601.693.869 EUR zum 30. September 2019 einem Rückgang um 13,07 % entspricht.

1. Neue Anteilsklassen

Die folgenden Anteilsklassen wurden während des Berichtsjahres zur Verfügung gestellt:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Egerton Equity			
Klasse X Thes.	EUR	EUR	6. November 2019
Schroder GAIA Helix			
Klasse I Thes. in JPY abgesichert	JPY	USD	6. November 2019
Schroder GAIA Sirios US Equity			
Klasse X Thes. in EUR abgesichert	EUR	USD	6. November 2019
Klasse X Thes.	USD	USD	8. Januar 2020
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse C Thes. in CHF abgesichert	CHF	USD	27. März 2020
Klasse C Thes. in EUR abgesichert	EUR	USD	27. März 2020
Klasse C Thes. in GBP abgesichert	GBP	USD	14. August 2020
Klasse I Thes. in JPY abgesichert	JPY	USD	14. August 2020
Schroder GAIA Wellington Pagosa			
Klasse C Thes. in BRL abgesichert	USD	USD	19. August 2020

2. Auflösung von Teilfonds

Im Berichtsjahr wurden 2 Teilfonds aufgelöst:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short	USD	17. September 2020
Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral	USD	17. September 2020

3. Auflösungen von Anteilsklassen

Zusätzlich zu den 30 Anteilsklassen in den vorstehend genannten aufgelösten Teilfonds wurden während des Berichtsjahres außerdem folgende Anteilsklassen aufgelöst:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA Contour Tech Equity Fund			
Klasse C1 Thes. in CHF abgesichert	CHF	USD	29. April 2020
Klasse C1 Thes. in EUR abgesichert	EUR	USD	29. April 2020
Klasse C1 Thes.	USD	USD	29. April 2020

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA
30. September 2020

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

In den letzten Monaten des Jahres 2019 einigten sich die USA und China auf ein Handelsabkommen der Phase 1, und ein Sieg der britischen Konservativen bei der Parlamentswahl sorgte schließlich für ein Ende der Brexit-Blockade. Jedoch dauerte dieses positive Umfeld nicht lange an, da die Verbreitung von COVID-19 ihren Anfang nahm und die wirtschaftlichen Auswirkungen der Pandemie klar wurden. Länder auf der ganzen Welt gingen in den Lockdown, um eine Eindämmung des Ausbruchs zu erreichen. Die Maßnahmen zur Eindämmung des Virus, insbesondere die Lockdowns, führten zu einem drastischen Rückgang der Wirtschaftsaktivität. Regierungen und Zentralbanken in aller Welt verkündeten umfangreiche und unerhörte politische Maßnahmen, um die Unternehmen und privaten Haushalte zu unterstützen und die Kosten für die Kreditaufnahme zu senken. Die US-Notenbank (Fed) senkte ihren Leitzins auf 0,25 % und kündigte eine erhebliche quantitative Lockerung an, während die Europäische Zentralbank ihr bestehendes Programm zur quantitativen Lockerung ausweitete. Die Bank of England senkte die Zinsen um 65 Basispunkte auf 0,10 %.

Im April gab es Erwartungen, dass die Lockdowns bald gelockert werden könnten und die Wirtschaft beginnen würde, sich zu erholen. Die COVID-19-Beschränkungen wurden rund um den Globus nach und nach aufgehoben, und es wurden weitere Unterstützungsmaßnahmen angekündigt. Anzeichen einer Konjunkturerholung und Optimismus hinsichtlich der Entwicklung eines Impfstoffs stützten die Anlegerstimmung. In Europa gab es anfängliche Sorgen bezüglich der Reaktion der Behörden auf die COVID-19-Krise und Anzeichen einer geringen Bereitschaft innerhalb der EU, die Unterstützung auf schwächere Mitglieder wie Italien auszuweiten. Diese wichen zunehmenden Erwartungen hinsichtlich eines Hilfsfonds, der im Juli angekündigt wurde und mit dem den am stärksten betroffenen Volkswirtschaften erhebliche Unterstützung zugesagt wurde, sowie verschiedenen positiven Initiativen zur Wachstumsförderung. Die EU-Spitzenpolitiker einigten sich auf einen Fondsumfang von 750 Milliarden Euro. Der Fonds wird zu 390 Milliarden Euro aus Beihilfen und zu 360 Milliarden Euro aus Krediten bestehen, die unter den EU-Mitgliedstaaten verteilt werden. Das Geld wird durch die Europäische Kommission aufgenommen und durch alle EU-Mitgliedstaaten garantiert.

Jedoch war eine erneute Eskalation der Spannungen zwischen den USA und China zu verzeichnen, die sich über den Handel hinaus ausweiteten. Die USA verschärften die Sanktionen gegen das chinesische Telekommunikationsunternehmen Huawei und verhängten Maßnahmen gegen den Halbleiterhersteller SMIC. Indes erlegte China der Sonderverwaltungszone Hongkong ein neues Sicherheitsgesetz auf, auf das westliche Länder mit Kritik reagierten. Die asiatischen Länder bekämpften die Pandemie zumeist erfolgreicher als viele westliche Nationen. Taiwan zählte verhältnismäßig wenige COVID-19-Fälle, was dem proaktiven Handeln der Regierung zuzuschreiben war, die einen Plan umsetzte, der im Anschluss an den SARS-Ausbruch im Jahr 2003 entwickelt worden war. Südkorea hielt hingegen die Ausbreitung des Virus durch ihr Nachverfolgungsprogramm im Griff. China, das als erstes Land von der Pandemie getroffen worden war, zählte auch zu den ersten Ländern, die sich von dieser erholten: Auf einen BIP-Absturz um 6,8 % im ersten Quartal folgte ein Wachstum um 3,2 % im zweiten Quartal.

In Japan führte die Pandemie zur Verschiebung der Olympischen Spiele in Tokio. Shinzo Abe gab am 28. August aufgrund des Wiederaufflammens eines langjährigen Gesundheitsproblems seinen Rücktritt als Premierminister bekannt, nur vier Tage, nachdem er den Rekord für die längste ununterbrochene Amtszeit eines japanischen Premierministers gebrochen hatte. Im Anschluss an seinen Rücktritt zeichnete sich schon bald Chefkabinettssekretär Yoshihide Suga als Spitzenkandidat ab und gewann die Wahl zum Vorsitzenden der LDP am 14. September.

Im September begannen die COVID-19-Fallzahlen in Europa erneut zu steigen, was der Wirtschaftsaktivität schadete, da erneut Lockdowns verhängt wurden. Die Brexit-Verhandlungen zwischen der EU und dem Vereinigten Königreich gingen weiter, jedoch kam man bis zum Ende des Berichtszeitraums zu keiner Einigung. Ungewissheit machte sich auch hinsichtlich der politischen Aussichten in den USA breit, da die Präsidentschaftswahl näher rückte.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Nach anfänglichen Fortschritten, da die Handelsspannungen zwischen den USA und China nachließen, was in der Unterzeichnung eines Abkommens der Phase 1 im Januar gipfelte, erlebten die weltweiten Aktien einen drastischen Abverkauf, als die COVID-19-Pandemie um sich griff. Der MSCI World erzielte dennoch eine Rendite von 10,4 % (Quelle: DataStream, Gesamtrendite, US-Dollar), trotz eines schwierigen Berichtszeitraums. Wachstumswerte lieferten eine grandiose Performance, sodass der MSCI World Growth Index eine Rendite von 30,5 % verzeichnete. Indes verlor der Value-Index an Boden und erzielte eine Rendite von -8,4 % (Quelle: DataStream, TR, US-Dollar).

Der US S&P 500 Index erzielte eine Rendite von 15,2 %. Sektoren, die davon profitierten, dass die Menschen von zu Hause aus arbeiteten und Freizeitaktivitäten nachgingen, erging es gut, wobei Informationstechnologie, zyklische Konsumgüter und Gesundheitswesen am stärksten zulegten. Der Energiesektor zeigte sich hingegen vor dem Hintergrund einer geringeren Nachfrage aufgrund der Lockdowns sehr schwach, und auch die Finanztitel und der Immobiliensektor gaben nach, da die Aktivität während der Pandemie nachließ.

Der MSCI EMU Index erzielte eine Rendite von -7,8 %. Energie, Finanzen und Telekommunikation gaben am meisten nach, insbesondere im letzten Teil des Berichtszeitraums, aufgrund der Auswirkungen des Virus auf die Wirtschaftsaktivität. Banktitel mussten auf Betreiben der Aufsichtsbehörden ihre Dividendenzahlungen aussetzen, um angesichts des Drucks auf die Wirtschaft ihre Widerstandsfähigkeit zu schützen. Informationstechnologie, Gesundheitswesen und Grundstoffe waren die größten Gewinner unter den Sektoren.

Im Vereinigten Königreich verzeichnete der FTSE All-Share Index eine Rendite von -16,6 %, aufgrund von Sorgen gegen Ende des Berichtszeitraums, dass es einen No-Deal-Brexit geben würde, der die COVID-19-bedingte Not noch verschlimmern würde. Auch Öl und Gas zeigten eine deutliche Underperformance, ebenso wie die Banken, wohingegen sich Freizeit-, Technologie- und Ausrüstungstitel äußerst stark entwickelten und erhebliche Gewinne verzeichneten. Der japanische Topix verzeichnete in Yen eine moderat positive Rendite von 4,9 %.

Der MSCI Emerging Markets Index legte in US-Dollar 10,4 % zu, aufgrund einer Erholung gegen Ende des Berichtszeitraums, genährt durch Hoffnungen auf einen Impfstoff gegen COVID-19 und die Aussicht auf eine Konjunkturerholung. Taiwan, China und Südkorea waren mit Abstand die Märkte mit der besten Performance im Index; und neben Argentinien waren sie die einzigen Märkte, die im positiven Bereich schlossen. China verhängte als erstes Land Lockdowns gegen die Ausbreitung des Virus. Es begann, die Beschränkungen während des Frühjahrs auf der Nordhalbkugel aufzuheben, wodurch sich die Wirtschaftsaktivität nach und nach normalisierte. Die Märkte von Taiwan und Südkorea wurden durch die starke Performance der Technologieaktien angeschoben. Hingegen verzeichnete Kolumbien einen steilen Absturz und erwies als der schwächste Markt im Index, da es durch den drastischen Einbruch der Rohölpreise und durch COVID-19 getroffen wurde. Auch Chile und Brasilien wiesen eine Underperformance auf. Thailand und Griechenland verzeichneten eine Underperformance, da die Pandemie den Tourismus traf, der in beiden Ländern erheblich zum BIP beiträgt. Indes belasteten niedrigere Rohölpreise und eine schwächere Nachfrage die russischen Aktien.

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

Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

Die letzten Monate des Jahres 2019 waren für die Finanzmärkte weitgehend stabil und stützend für Vermögenswerte. Dies resultierte aus zwei Zinssenkungen um 25 Basispunkte (Bp.) durch die US-Notenbank (Fed) im August und September sowie aus weiterer Unterstützung durch die Europäische Zentralbank (EZB). Es gab ein Handelsabkommen der Phase 1 zwischen den USA und China, das zu größerem Optimismus hinsichtlich des Wirtschaftswachstums führte. Insgesamt waren diese Faktoren jedoch sowohl für Staats- als auch für Unternehmensanleihen im späten Jahr 2019 hilfreich.

Die ersten Monate 2020 waren jedoch turbulent. Der Ausbruch der COVID-19-Pandemie führte dazu, dass in vielen Ländern Lockdown-Maßnahmen verhängt wurden, wodurch faktisch große Bereiche der Weltwirtschaft geschlossen wurden. Im März erlebten praktisch alle Märkte eine erhebliche Volatilität. Die Einbrüche bei risikoreicheren Anlagen zählten zu den stärksten in der jüngeren Geschichte, während die Anleihemärkte durch einen drastischen Rückgang der Liquidität beeinträchtigt wurden.

Zwischenzeitlich stiegen die Renditen der Staatsanleihen steil an und kurzlaufende Unternehmensanleihen sackten ab, als in Panik geratene Anleger unterschiedslos alles verkauften, um Barmittel zu realisieren. Letzten Endes gaben die Renditen von Staatsanleihen infolge der Krise nach.

Ab Anfang April löste eine konsequente politische Reaktion der Regierungen und Zentralbanken eine starke Erholung des Marktes aus. Die Wirtschaftsdaten bestätigten eine tiefe weltweite Rezession mit einigen Rekordrückgängen im zweiten Quartal, erholten sich aber seit März gut.

Die Rendite 10-jähriger US Treasurys startete in den Berichtszeitraum bei 1,66 %, beendete das Jahr 2019 bei 1,92 % und fiel anschließend auf 0,68 %. Die 10-jährige Rendite verzeichnete einen monatlichen Rückgang um 40 Basispunkte (Bp.) im Januar, Februar und März, und im März erreichte sie kurzzeitig ein Tief von fast 0,3 %.

Die europäischen Renditen gaben nach, fielen aber uneinheitlicher aus. Dies spiegelte Sorgen bezüglich der Reaktion der Behörden auf die COVID-19-Krise wider, insbesondere Anzeichen einer geringen Bereitschaft, die Unterstützung auf Italien auszuweiten, und Anzeichen einer Spaltung innerhalb der EU.

Die 10-jährige deutsche Rendite fiel von -0,57 % auf -0,52 %, nachdem sie das Jahr 2019 bei -0,19 % beendet hatte. Sie war im März vor dem Hintergrund der außergewöhnlichen Marktbedingungen volatil. Die italienische 10-Jahres-Rendite war volatil, wobei sie sich über den Gesamtzeitraum kaum änderte und von 0,82 % auf 0,87 % stieg. Sie war während weiten Teils des Jahres 2019 aufgrund des verringerten politischen Risikos erheblich gefallen, stieg jedoch während der COVID-19-Krise deutlich an. Nachdem sie das Jahr 2019 bei knapp über 1,4 % beendet hatte, sprang sie im März auf 3 %. Dies geschah aufgrund von Sorgen wegen der anfänglichen Reaktion der EU und Schwierigkeiten, sich über Unterstützungsmaßnahmen für stark durch die Pandemie getroffene Länder zu einigen.

Die Anlegerstimmung in Bezug auf Europa hellte sich von Juli an deutlich auf, nachdem die EU eine historische Vereinbarung zur Auflegung eines 750 Milliarden schweren Pandemie-Hilfsfonds getroffen hatte. Dieser wird Ländern Beihilfen und Kredite bereitstellen, damit sie die Auswirkungen von Covid überwinden können, und wird durch EU-Anleihen finanziert.

Die britischen 10-Jahres-Renditen sprangen im Oktober aufgrund von Anzeichen von Fortschritten bei den Brexit-Gesprächen mit der Republik in die Höhe, gaben dann aber vor dem Hintergrund der COVID-19-Krise deutlich nach. Insgesamt fiel die Rendite während des Berichtszeitraums von 0,49 % auf 0,23 %. Sie gab im September nach, als die Ungewissheit bezüglich des Brexits wieder aufflammte, da die britische Regierung faktisch damit drohte, das bereits vereinbarte Austrittsabkommen zu kippen. Die Bank of England gab bekannt, sie denke über die Möglichkeit negativer Zinssätze nach.

Die Unternehmensanleihen lieferten positive Gesamtergebnisse (in lokaler Währung), blieben jedoch moderat hinter den Staatsanleihen zurück. Die weltweiten Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating (IG) verzeichneten eine Rendite von 5,6 %, unterstützt durch sinkende Zinsen sowie durch Renditen aus Erträgen. Unternehmensanleihen mit High-Yield-Rating (HY) wurden auf dem Höhepunkt der Marktturbulenzen schwer getroffen, erholten sich jedoch gut, mit Gewinnen von 2,6 %.

Ausblick

Die Wirtschaftsexperten von Schroders prognostizieren für 2020 ein weltweites Wachstum von -4,6 % und eine Erholung von 5,1 % im Jahr 2021. Kurzfristig gleicht der prognostizierte Wachstumspfad einem Quadratwurzel-Zeichen, da auf die rasche V-förmige Erholung eine Einebnung der Aktivität folgt. Insgesamt handelt es sich beim Wachstumsprofil nach wie vor um eine U-förmige Erholung. Im Jahr 2021 sollte sich das weltweite Wachstum verbessern, gestützt durch eine lockere Finanz- und Geldpolitik. Die Prognose geht auch von der Verfügbarkeit eines Impfstoffs Mitte des Jahres aus, der im dritten Quartal verteilt wird. Letzteres ist von größter Bedeutung für die Überwindung der Zurückhaltung von Unternehmen und Verbrauchern, die vermutlich Investitions- und Konsumausgaben aufschieben. Die Wirtschaftsexperten von Schroders prognostizieren eine weltweite Inflation von 1,8 % für 2020 und 2,0 % für 2021.

Im Hinblick auf die Geld- und Finanzpolitik in den USA erwarten wir keine Änderung der Zinssätze in diesem und im nächsten Jahr. Die Bilanz der Fed dürfte sich um 2 Billionen USD auf 9 Billionen USD zum Ende des Jahres 2021 ausweiten. Was die Bank of England (BoE) betrifft, so ist es unwahrscheinlich, dass diese Zentralbank über den zweijährigen Prognosehorizont wesentliche Änderungen vornimmt. Ebenso gehen wir davon aus, dass die EZB alle Zinssätze unverändert lässt, jedoch den Umfang der quantitativen Lockerung um 500 Milliarden Euro vergrößert, um die Käufe bis Ende 2021 aufrechtzuerhalten. Dies wird ausreichend Zeit gewähren, um den EU-Hilfsfonds auszubehalten. Es wird erwartet, dass die Bank of Japan (BoJ) die Zinssätze unverändert hält und mit der quantitativen Lockerung fortfährt, da sich die Inflation in den negativen Bereich bewegt. In Anbetracht der jüngsten Guidance der Chinesischen Volksbank (PBoC) gehen wir von weniger Zinssenkungen als zuvor aus, mit einem Mindestreservesatz von 11 % Ende 2020 und 10 % im Jahr 2021.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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



Prüfbericht

An die Anteilhaber von
Schroder GAIA

Unser Prüfungsurteil

Unseres Erachtens zeigt der beiliegende Jahresabschluss ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Finanzlage von Schroder GAIA (der „Fonds“) und seiner jeweiligen Teilfonds zum 30. September 2020 sowie ihrer Betriebsergebnisse und Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr im Einklang mit den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Jahresabschlusses.

Umfang unserer Prüfung

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020;
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung für das abgelaufene Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr;
- das Anlageportfolio zum 30. September 2020 und
- die Anmerkungen zum Abschluss, die einen Überblick über die wesentlichen Rechnungslegungsmethoden enthalten.

Grundlage des Bestätigungsvermerks

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

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

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

Sonstige Angaben

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

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

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

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n° 10028256) R.C.S.
Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*



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

Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss

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

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

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

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

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

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

Prüfbericht (Forts.)



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

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 12. Januar 2021

Bertrand Jaboulay

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020

	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	66.305.938	1.132.366.818	188.315.671	810.943.342	361.008.148
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(5.711.540)	(11.121.582)	34.796.852	164.470.039	7.451.805
Wertpapiere zum Marktwert	60.594.398	1.121.245.236	223.112.523	975.413.381	368.459.953
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)					
aus Devisenterminkontrakten	(623.891)	546.333	492.372	(5.644.112)	(254.606)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	828.398	-	-	-	840.762
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	1.517.277	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	(886.377)	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	13.959.928	7.225.966
aus Differenzkontrakten	(87.891)	-	2.248.724	-	(1.875.210)
	747.516	546.333	2.741.096	8.315.816	5.936.912
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	7.045.914	550	6.443.225	1.736.585	1.843.557
Bankguthaben	6.696.772	112.282.183	2.190.946	4.215.878	44.532.659
Broker-Einschusskonto	4.223.740	-	-	-	3.085.759
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	10.455.723	12.070.000	6.012.692	51.946.169	2.614.347
Forderungen aus Zeichnungen	-	1.427.686	-	-	983.347
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	170.080	178.508
Dividenden und Zinsforderungen	597.913	9.685.954	145.009	871.009	1.918.237
Erstattungsforderung des Fonds	15.399	-	-	-	11.199
Gründungsaufwand	3.710	-	-	-	-
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	2.266.916	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	650.000	8.262.792	1.281.052	760.000	1.268.593
Sonstige Forderungen	-	-	-	2.093.084	-
GESAMTVERMÖGEN	91.031.085	1.265.520.734	241.926.543	1.047.788.918	430.833.071
VERBINDLICHKEITEN					
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	1.153	995.000	1.690.803	6.286.100	21.537.594
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Anteilen	-	1.343.780	-	-	59.658
Fällige Managementgebühren	75.738	1.074.100	224.520	1.148.375	96.992
Fällige Performancegebühren	-	-	5.086.839	19.906.246	1.620.362
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	53.861	-	604.494	1.014.317	265.026
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	1.499.513	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	580.000	6.562.792	1.081.052	-	1.008.593
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	70.000	1.700.000	200.000	3.026.916	260.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	2.312.407	10.402.254	2.243.872	953.159	1.796.312
SUMME VERBINDLICHKEITEN	3.093.159	22.077.926	12.631.093	32.335.113	26.644.537
SUMME NETTOVERMÖGEN	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettvermögensaufstellung zum 30. September 2020 (Forts.)

	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
VERMÖGENSWERTE					
Anlagen					
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	411.461.988	784.371.758	56.403.120	426.072.511	3.747.258.450
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	49.733.608	325.955	(7.485.526)	9.501.087	228.709.229
Wertpapiere zum Marktwert	461.195.596	784.697.713	48.917.594	435.573.598	3.975.967.679
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)					
aus Devisenterminkontrakten	912.505	7.959.743	(407.931)	5.681.561	6.456.740
aus Kassageschäften	-	(3.794)	-	-	(3.236)
aus Terminkontrakten	-	928.784	(19.090)	(246.380)	1.984.674
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	521.257	444.588
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	125.700	-	(173.553)	1.253.293
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	(1.831.705)	(1.562.288)
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	(420.724)	(1.114.846)
aus Total Return Swaps	3.102.679	(3.847.192)	-	2.865.277	21.931.893
aus Differenzkontrakten	-	-	(84.314)	-	150.819
	4.015.184	5.163.241	(511.335)	6.395.733	29.541.637
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	11.617.652	17.653	243.932	12.180.057	35.395.476
Bankguthaben	35.366.427	578.312.001	3.129.997	75.211.442	736.555.198
Broker-Einschusskonto	-	50.027.692	-	17.386.915	63.733.300
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	-	38.578.709	809.380	44.673.469	150.414.611
Forderungen aus Zeichnungen	476.375	-	-	-	2.462.713
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	3.549.649	3.349.880
Dividenden und Zinsforderungen	500.983	13.927	57.895	1.611.039	13.279.015
Erstattungsforderung des Fonds	-	-	-	-	22.686
Gründungsaufwand	-	-	-	-	3.164
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	180.000	-	2.465.017
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	1.519.325	7.250.000	110.000	2.783.124	20.510.800
Sonstige Forderungen	-	-	870.647	-	3.051.282
GESAMTVERMÖGEN	514.691.542	1.464.060.936	53.808.110	599.365.026	5.036.752.458
VERBINDLICHKEITEN					
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	-	1.083.695	50.896	38.181.428	60.493.399
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Anteilen	11.061.327	-	44.265	-	10.680.099
Fällige Managementgebühren	637.703	1.740.541	44.119	565.928	4.962.995
Fällige Performancegebühren	97.978	309	13.199	61.864	25.778.039
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	445.477	315.460	98.412	771.932	3.217.597
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	1.920.000	-	-	-	1.637.597
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	1.278.957
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	1.199.325	6.060.000	-	2.263.124	15.996.321
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	320.000	1.190.000	290.000	520.000	6.979.495
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	2.580.603	16.531.368	34.776	5.110.378	35.941.489
SUMME VERBINDLICHKEITEN	18.262.413	26.921.373	575.667	47.474.654	166.965.988
SUMME NETTOVERMÖGEN	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372	4.869.786.470

* Für die in Euro angegebene Summe der Nettvermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2020 umgerechnet: 1 Euro = 1,17245 US-Dollar und 1 Euro = 0,90863 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020 (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	Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short* USD
Nettoinventarwert						
zum 30. September 2020	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534	-
zum 30. September 2019	90.737.733	1.338.107.686	149.869.826	1.024.540.653	235.393.291	20.098.543
zum 30. September 2018	240.744.953	1.195.973.408	187.543.754	1.328.047.587	149.691.574	-
Im Umlauf befindliche Anteile**						
zum 30. September 2020						
Klasse A Thes.	13.648	374	115.278	497.081	15	-
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	220	-	253	-	100	-
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	8.418	-	22.043	-	100	-
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	13.327	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	100	-	100	-	140	-
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	346.333	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	1.007	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	28.521	22.835	-	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	96.855	-	-
Klasse C Thes.	240.255	623	712.245	1.814.624	18.774	-
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	3.638	385	2.610	-	100	-
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	82.413	9	421.745	-	137.591	-
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	311.673	100	170.680	291.164	33.102	-
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	103.997	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	73.323	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	100	-	140	-
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	1.314.383	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	4.973	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	9.804	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	302	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	1	-
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	2	-
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	2	-
Klasse E Thes.	84.090	-	26.291	1.475	320.666	-
Klasse E Thes. CHF	19	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	128	-	3.307	-	500	-
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	5.000	-	85.657	-	158.498	-
Klasse E Thes. GBP	18	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	90	-	57.604	-	30.243	-
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	56.474	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	100	-	140	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	125.065	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	22.589	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	3.300	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	48.201	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	222	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	318	-	-	-	-
Klasse I Thes.	15	35.305	15	14	2.113.413	-
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	20.732	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	9	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	120	-	-	103	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	65	-	-
Klasse IF Thes.	-	165.412	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	116.654	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	418.514	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	5.313	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1.250	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	296.878	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	712.885	-

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020 (Forts.)

	Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 30. September 2020	-	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372
zum 30. September 2019	20.070.521	771.660.956	1.796.666.842	63.415.401	488.290.256
zum 30. September 2018	-	957.003.961	1.796.456.487	-	230.154.165
Im Umlauf befindliche Anteile**					
zum 30. September 2020					
Klasse A Thes.	-	1.040.602	-	-	177.207
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	-	7.515	-	-	1.893
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	-	218.063	-	-	119.747
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	16.833
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	15
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	-	1.411.985	4.566.017	8.749	2.172.744
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	46.399
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	-	16.707	100.412	1.217	538.930
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	-	464.802	3.188.894	221.153	1.202.890
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	-	71.247	1.887.977	-	457.177
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	96
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	23.444	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	-	5.092	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	6
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	43
Klasse E Thes.	-	5.778	-	-	65.224
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	59.891
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	-	28.146	-	-	187.080
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	96.379
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	96
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	15	15	15	15
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	1.606.543	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	3.583	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	169.088	251	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	77	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	244.505	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	33.424	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	11.865	-
Klasse X Thes.	-	15	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	216.428	-	-	-

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

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

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020 (Forts.)

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

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020 (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	Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short* USD
Nettoinventarwert je Anteil**						
zum 30. September 2019						
Klasse A Thes.	90,19	1.343,87	98,08	192,44	99,44	99,86
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	81,10	-	93,34	-	96,39	99,85
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	83,43	-	93,49	-	96,73	99,85
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	179,02	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	123,65	-	137,19	-	98,58	139,80
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	185,96	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	189,83	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	98,54	182,12	-	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	180,78	-	-
Klasse C Thes.	91,67	1.343,89	99,97	204,59	99,96	99,87
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	82,83	-	95,24	-	97,25	99,86
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	84,25	-	95,20	-	97,58	99,86
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	88,21	-	78,01	188,52	98,52	79,88
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	26.296,37	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	782,57	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	139,16	-	99,45	139,81
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	196,82	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	204,38	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	202,06	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	88,61	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	100,82	-	4.896,70	-
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	95,35	-	4.862,29	-
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	95,34	-	4.879,79	-
Klasse E Thes.	94,51	-	100,74	203,46	100,27	99,87
Klasse E Thes. CHF	88,76	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	84,18	-	95,56	-	97,52	99,86
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	86,46	-	95,98	-	97,95	99,86
Klasse E Thes. GBP	102,29	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	91,87	-	77,78	-	98,81	79,88
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	785,09	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	139,72	-	99,61	139,81
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	91,25	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1.344,00	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.094,39	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.143,68	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1.157,07	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1.555,75	-	-	-	-
Klasse I Thes.	100,54	1.476,61	105,40	276,20	99,36	99,90
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.291,72	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.354,51	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	217,03	-	-
Klasse IF Thes.	-	1.376,55	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.203,99	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.262,49	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	1.376,52	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	90,97	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	97,60	-

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020 (Forts.)

	Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil**					
zum 30. September 2019					
Klasse A Thes.	99,72	146,28	-	-	101,02
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	99,71	180,04	-	-	95,72
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	99,71	135,14	-	-	96,38
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	139,60	-	-	-	139,72
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	100,16
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	99,73	150,94	127,22	100,92	102,25
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	99,72	183,52	118,41	129,30	96,86
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	99,72	139,08	120,03	114,72	97,55
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	79,77	143,50	122,85	-	79,51
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	139,62	-	-	-	141,47
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	133,02	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	-	143,44	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.115,13
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	4.846,62
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	4.877,98
Klasse E Thes.	99,73	160,53	-	-	102,99
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	99,72	-	-	-	97,61
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	99,72	148,43	-	-	98,30
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	79,77	-	-	-	80,14
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	139,62	-	-	-	142,59
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	99,76	188,48	143,26	102,17	104,76
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	125,56	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	116,85	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	118,25	114,20	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	131,91	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	100,92	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	114,72	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	133,03	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020 (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR
Nettoinventarwert je Anteil**				
zum 30. September 2018				
Klasse A Thes.	78,65	-	106,21	190,18
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	73,13	-	104,72	-
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	74,75	-	104,63	-
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	175,04
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	108,42	-	149,87	-
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	178,50
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	188,50
Klasse A1 Thes.	-	-	107,24	180,71
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	174,23
Klasse C Thes.	79,34	-	107,45	200,97
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	74,13	-	106,05	-
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	74,86	-	105,72	-
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	77,47	-	85,41	183,26
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	25.755,56
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	868,11	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	150,88	-
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	188,12
Klasse C Aussch.	-	-	-	200,79
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	199,46
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	77,79	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	108,26	-
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	106,19	-
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	105,90	-
Klasse E Thes.	81,59	-	108,00	199,89
Klasse E Thes. CHF	76,51	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	76,02	-	106,16	-
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	76,70	-	106,32	-
Klasse E Thes. GBP	84,54	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	81,71	-	85,01	-
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	868,82	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	151,11	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	79,94	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1.331,42	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.122,69	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.168,75	-	-
Klasse F Aussch.	-	1.205,58	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1.633,43	-	-
Klasse I Thes.	85,47	1.439,77	111,42	266,44
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.304,18	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.361,97	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	203,17
Klasse IF Thes.	-	1.358,22	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.230,15	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.284,93	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	79,69	-	-	-

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2020 (Forts.)

	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil**				
zum 30. September 2018				
Klasse A Thes.	-	144,32	-	99,55
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	-	183,81	-	97,68
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	-	137,63	-	97,98
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	138,84
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	99,37
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes.	-	148,00	118,74	100,01
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	-	186,19	113,68	98,11
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	-	140,73	114,72	98,43
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	-	143,48	116,23	79,22
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	139,50
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	-	143,42	-	-
Klasse C1 Thes.	4.924,17	-	-	5.003,60
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	4.906,43
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	4.921,78
Klasse E Thes.	-	156,75	-	100,22
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	98,39
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	-	149,52	-	98,69
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	79,44
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	139,91
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes.	98,90	181,63	129,25	100,87
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	117,64	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	112,56	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	113,48	-
Klasse K Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short* USD
ERTRÄGE						
Nettoausschüttungen	-	-	-	-	13.151.586	131.462
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1.399.892	77.531.833	-	-	26.802	-
Nettoertrag aus Swaps	660.750	-	14.545	-	449.128	-
Bankzinsen	104.062	383.120	122.739	-	143.308	11.039
Sonstige Erträge	-	-	-	-	21.261	-
Erträge insgesamt	2.164.704	77.914.953	137.284	-	13.792.085	142.501
AUFWAND						
Performancegebühren	-	-	5.086.839	22.937.289	1.620.363	-
Managementgebühren	1.074.143	13.332.560	2.062.749	13.724.630	893.464	5.210
Nettodividendenaufwand	-	-	1.292.096	1.037.514	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	793.946	-	30.414
Verwahrstellengebühren	176.584	348.878	46.012	279.454	107.268	7.167
Verwaltungsgebühren	297.398	2.074.785	524.849	3.140.195	356.738	17.799
Taxe d'abonnement	45.744	123.276	85.737	460.088	63.424	1.986
Vertriebsgebühren	-	-	13.073	117.568	-	-
Abschreibung des Gründungsaufwands	19.998	-	-	-	-	-
Liquidationskosten	-	-	-	-	-	20.000
Bank- und Zinskosten	1.569	-	688	540.184	2.394	20
Sonstige Aufwendungen	120.951	393.109	88.123	2.234.395	129.630	4.823
Aufwendungen insgesamt	1.736.387	16.272.608	9.200.166	45.265.263	3.173.281	87.419
Abzüglich: Kostenzuschüsse	(15.399)	-	-	-	(11.199)	-
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	443.716	61.642.345	(9.062.882)	(45.265.263)	10.630.003	55.082

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 (Forts.)

	Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
ERTRÄGE						
Nettoausschüttungen	-	2.779.076	209.080	174.744	284.173	14.312.643
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	675.638	230	340.519	4.227.089	71.901.466
Nettoertrag aus Swaps	74.833	-	-	-	-	1.022.863
Bankzinsen	14.685	283.031	4.989.929	13.946	395.980	5.514.852
Sonstige Erträge	-	93	-	-	1.581	19.562
Erträge insgesamt	89.518	3.737.838	5.199.239	529.209	4.908.823	92.771.386
AUFWAND						
Performancegebühren	-	97.978	309	13.199	61.864	28.809.083
Managementgebühren	5.929	9.991.720	24.063.732	647.503	6.937.025	64.218.927
Nettodividendenaufwand	16.977	-	-	-	-	2.154.042
Nettoaufwand aus Swaps	-	2.998.867	26.361.757	359.130	5.416.355	30.876.932
Verwahrstellengebühren	6.975	189.910	465.912	19.044	295.470	1.702.755
Verwaltungsgebühren	17.768	2.150.909	5.201.040	175.322	1.789.086	13.935.196
Taxe d'abonnement	2.075	299.672	774.967	31.630	274.444	1.920.396
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	7	128.724
Abschreibung des Gründungsaufwands	-	-	-	-	-	17.057
Liquidationskosten	20.000	-	-	-	-	34.117
Bank- und Zinskosten	-	61	-	-	74.022	607.354
Sonstige Aufwendungen	4.760	316.190	604.204	34.819	293.300	3.940.240
Aufwendungen insgesamt	74.484	16.045.307	57.471.921	1.280.647	15.141.573	148.344.823
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	-	-	-	-	(22.686)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	15.034	(12.307.469)	(52.272.682)	(751.438)	(10.232.750)	(55.550.751)

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Ertrags- und Aufwandsrechnung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2020 umgerechnet: 1 Euro = 1,17245 US-Dollar und 1 Euro = 0,90863 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short* USD
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***	443.716	61.642.345	(9.062.882)	(45.265.263)	10.630.003	55.082
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	(2.130.563)	(31.159.081)	26.341.795	142.740.139	(5.069.835)	1.695.945
aus Devisenterminkontrakten	1.644.430	41.430.698	4.071.159	8.355.637	5.655.994	5.350
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	(1.287.005)	-	(22)	-	10.449.446	-
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	(2.472.235)	-	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	4.698.985	-	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	(40.993.775)	6.118.402	-
aus Differenzkontrakten	-	-	(11.981.471)	-	1.774.275	(1.951.496)
aus Optionen und Swaptions	910.369	-	(99.797)	3.023.507	926.736	-
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	(2.963.811)	669.673	(293.233)	2.435.459	(4.248.859)	-
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	(1.599.830)	10.941.290	18.038.431	115.560.967	15.606.159	(250.201)
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)						
aus Anlagen	187.390	44.948.353	36.358.798	44.037.564	1.462.641	91.128
aus Devisenterminkontrakten	(1.561.557)	5.931.618	1.112.064	4.505.814	112.253	496
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	826.090	-	-	-	808.285	-
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	1.174.601	-	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	(1.967.096)	-	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	(40.174.205)	11.883.953	-
aus Differenzkontrakten	(280.046)	-	(3.040.899)	-	(1.484.982)	(72.070)
aus Optionen und Swaptions	(675)	-	154.283	(231.486)	(180.842)	-
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	3.200.477	52.059	(2.221)	(14.134)	80.194	-
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	1.579.184	50.932.030	34.582.025	8.123.553	12.681.502	19.554
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	423.070	123.515.665	43.557.574	78.419.257	38.917.664	(175.565)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	18.240.089	220.665.425	130.759.666	410.602.638	175.753.755	328.529
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(21.394.080)	(438.588.354)	(94.891.616)	(498.108.743)	(45.876.176)	(20.251.507)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	(68.886)	(257.614)	-	-	-	-
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	(2.799.807)	(94.664.878)	79.425.624	(9.086.848)	168.795.243	(20.098.543)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	90.737.733	1.338.107.686	149.869.826	1.024.540.653	235.393.291	20.098.543
Nennwährungsanpassung****	-	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534	-

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

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

**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2019 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2020.

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020

	Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***	15.034	(12.307.469)	(52.272.682)	(751.438)	(10.232.750)	(55.550.751)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	154.798	33.011.876	20.832.305	402.595	20.800.374	198.177.133
aus Devisenterminkontrakten	4.744	6.446.204	3.356.985	1.145.689	10.561.788	72.030.585
aus Kassageschäften	-	-	(113.874)	-	-	(97.125)
aus Terminkontrakten	-	-	(41.373.949)	(70.271)	(11.231.357)	(37.130.421)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	2.170.653	1.851.382
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	(7.120.808)	-	(3.154.620)	(10.872.671)
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1.482.449)	(1.264.403)
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	9.399.972	12.025.210
aus Total Return Swaps	-	(75.537.851)	8.103.397	-	(11.746.886)	(103.310.240)
aus Differenzkontrakten	(2.962.912)	-	-	2.609.278	-	(10.025.777)
aus Optionen und Swaptions	-	(2.010.800)	-	17.468	2.304.747	4.775.219
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	-	(1.465.330)	549.148	(995)	(1.494.997)	(5.452.888)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	(2.803.370)	(39.555.901)	(15.766.796)	4.103.764	16.127.225	120.706.004
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)						
aus Anlagen	122.562	(12.120.005)	(6.990.953)	(5.534.181)	11.515.665	102.406.407
aus Devisenterminkontrakten	496	2.006.295	16.056.266	(603.872)	4.555.049	27.904.487
aus Kassageschäften	-	-	6.586	-	-	5.617
aus Terminkontrakten	-	-	6.018.100	(19.090)	225.895	6.698.569
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(566.056)	(482.797)
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	241.157	-	(216.624)	1.022.759
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1.630.120)	(1.390.353)
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(2.686.551)	(3.969.165)
aus Total Return Swaps	-	15.415.255	(44.448.726)	-	2.325.279	(52.818.019)
aus Differenzkontrakten	(76.676)	-	-	162.211	-	(4.047.391)
aus Optionen und Swaptions	-	-	-	-	(465.183)	(651.476)
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	-	5.336	117.189	(9)	1.260.142	4.005.794
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	46.382	5.306.881	(29.000.381)	(5.994.941)	14.317.496	78.684.432
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	(2.741.954)	(46.556.489)	(97.039.859)	(2.642.615)	20.211.971	143.839.685
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	1.186.278	253.479.272	327.637.112	13.565.787	275.498.426	1.622.639.985
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(18.514.845)	(482.154.610)	(590.124.532)	(21.106.130)	(232.110.281)	(2.179.323.572)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	-	-	-	-	(278.477)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	(20.070.521)	(275.231.827)	(359.527.279)	(10.182.958)	63.600.116	(413.122.379)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	20.070.521	771.660.956	1.796.666.842	63.415.401	488.290.256	5.601.693.869
Nennwährungsanpassung****	-	-	-	-	-	(318.785.020)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	-	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372	4.869.786.470

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Veränderung des Nettovermögens wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2020 umgerechnet: 1 Euro = 1,17245 US-Dollar und 1 Euro = 0,90863 Pfund Sterling.

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

**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2019 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2020.

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	68,91	90,17	-	-	43,76
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	-
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	0,18
Bekleidung	-	-	-	-	0,56
Automobilhersteller	-	-	-	2,83	0,33
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,75
Banken	-	-	-	-	6,78
Getränke	-	-	-	1,28	0,10
Biotechnologie	-	-	-	-	-
Baustoffe	-	-	-	2,68	0,72
Chemie	-	-	-	2,23	0,42
Gewerbliche Dienstleistungen	-	-	6,72	5,90	-
Computer	-	-	-	-	1,09
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	4,38	1,86
Elektrik	-	-	-	-	0,09
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,36
Elektronik	-	-	5,06	-	0,26
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,01
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-
Unterhaltung	-	-	3,70	0,20	-
Umweltschutz	-	-	-	-	0,07
Lebensmittel	-	-	-	-	1,71
Gas	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	0,26
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	-	3,63	0,27
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	-
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	4,34	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	1,64
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherungen	-	-	-	1,07	0,33
Internet	-	-	22,39	30,61	2,59
Investmentgesellschaften	-	-	-	1,63	6,93
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,70
Freizeit	-	-	-	-	0,06
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	-
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,14
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	0,28
Medien	-	-	12,63	9,46	-
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	-
Bergbau	-	-	-	-	2,22
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	0,21
Öl und Gas	-	-	-	-	4,21
Öl- und Gasdienstleistungen	-	-	-	-	-

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Verpackung und Container	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	0,29
Pipelines	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	-	0,41	0,24
Einzelhandel	-	-	-	2,64	1,99
Bausparkassen	-	-	-	-	-
Halbleiter	-	-	8,77	2,87	8,50
Software	-	-	36,71	5,50	0,53
Lagerung	-	-	-	-	-
Telekommunikation	-	-	1,32	4,25	0,72
Spielwaren, Spiele und Hobbys	-	-	-	2,64	-
Transport	-	-	-	7,51	-
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	68,91	90,17	97,30	96,06	91,16
Sonstiges Nettovermögen	31,09	9,83	2,70	3,94	8,84
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	3,72	54,25	46,08	45,93
Sonstige Wertpapiere				
Werbung	-	-	-	0,05
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	3,75	-	-	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	0,06
Fluggesellschaften	1,01	-	-	0,00
Bekleidung	-	-	-	0,11
Automobilhersteller	-	-	-	-
Autoteile und -zubehör	-	-	-	0,06
Banken	2,87	-	1,29	4,31
Getränke	2,19	-	1,22	0,14
Biotechnologie	-	-	-	3,20
Baustoffe	1,36	-	-	0,04
Chemie	3,77	-	-	0,26
Gewerbliche Dienstleistungen	3,99	-	7,45	1,49
Computer	1,58	-	3,19	0,37
Vertrieb und Großhandel	0,30	-	-	0,18
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	1,40	-	0,28	1,91
Elektrik	-	-	-	1,71
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	0,07
Elektronik	4,45	-	2,84	0,27
Energie – Alternative Energiequellen	0,17	-	-	0,18
Bau- und Ingenieurwesen	5,19	-	-	0,35
Unterhaltung	-	-	1,13	0,32
Umweltschutz	0,78	-	-	0,01
Lebensmittel	0,52	-	-	-
Gas	-	-	-	0,21
Gesundheitswesen – Produkte	7,71	-	1,71	1,36
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	3,03	-	-	0,64
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	0,69
Wohngebäude-Bauträger	1,36	-	-	0,24
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	0,09
Haushaltswaren	0,99	-	2,08	-
Versicherungen	0,54	-	-	3,85
Internet	-	-	-	0,51
Investmentgesellschaften	-	0,35	-	0,35
Eisen und Stahl	-	-	-	0,14
Freizeit	1,59	-	1,24	0,23
Beherbergungsunternehmen	1,97	-	-	0,06
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	0,06
Maschinen – Diversifiziert	0,25	-	1,03	0,17
Medien	1,16	-	-	0,03
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	0,10
Bergbau	-	-	-	0,19
Diverse Fertigungsbetriebe	1,18	-	2,49	0,15
Öl und Gas	0,49	-	-	4,24
Öl- und Gasdienstleistungen	-	-	-	0,24

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)				
Verpackung und Container	1,36	-	-	-
Pharmazeutika	7,47	-	-	2,13
Pipelines	-	-	-	0,33
Immobilien	-	-	4,98	0,62
Einzelhandel	6,49	-	3,64	0,44
Bausparkassen	-	-	-	0,04
Halbleiter	5,51	-	-	0,17
Software	9,03	-	8,90	0,31
Lagerung	-	-	2,34	-
Telekommunikation	2,84	-	-	0,22
Spielwaren, Spiele und Hobbys	1,16	-	-	0,02
Transport	1,72	-	-	0,07
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	92,90	54,60	91,89	78,92
Sonstiges Nettovermögen	7,10	45,40	8,11	21,08
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigte Staaten		53.729.528	61,10
8.000.000	United States Treasury Note 15/10/20, 1.63%	8.004.695	9,10
6.000.000	United States Treasury Note 30/11/20, 2.75%	6.026.052	6,85
8.000.000	United States Treasury Note 31/01/21, 1.38%	8.033.079	9,13
6.000.000	United States Treasury Note 28/02/21, 2.50%	6.059.080	6,89
10.100.000	United States Treasury Note 15/04/21, 2.38%	10.224.039	11,64
9.100.000	United States Treasury Note 15/05/21, 3.13%	9.271.201	10,54
2.800.000	United States Treasury Note 15/07/21, 2.63%	2.855.349	3,25
3.200.000	United States Treasury Note 15/08/21, 2.13%	3.256.033	3,70
Summe Anleihen		53.729.528	61,10
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		53.729.528	61,10

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Irland		6.864.870	7,81
738.158.060	Star Compass Public 18/11/20, ZCP	6.864.870	7,81
Summe Anleihen		6.864.870	7,81
Summe sonstige Wertpapiere		6.864.870	7,81
Summe Kapitalanlagen		60.594.398	68,91
Sonstiges Nettovermögen		27.343.528	31,09
Nettoinventarwert		87.937.926	100,00

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Bermuda		414.953.071	33,37
6.563.000	3264 Re 07/02/23, variabel	6.687.369	0,54
20.400.000	Bowline Re Series 2018-1 23/05/22, variabel	20.441.819	1,65
4.250.000	Bowline Re Series 2019-1 20/03/23, variabel	4.327.563	0,35
2.350.000	Cape Lookout Re 25/02/22, variabel	2.378.553	0,19
4.000.000	Cerulean Re SAC 08/07/21, variabel	3.980.000	0,32
20.170	Eden Re II Series A 22/03/22, ZCP	219.336	0,02
6.006	Eden Re II Series B 22/03/22, ZCP	162.600	0,01
69.000	Eden Re II Series A 22/03/23, ZCP	560.045	0,05
113.501	Eden Re II Series B 22/03/23, ZCP	947.994	0,08
18.000.000	Eden Re II 22/03/24, ZCP	19.979.999	1,61
17.500.000	FloodSmart Re Series A 07/03/22, variabel	17.443.124	1,40
3.000.000	FloodSmart Re Series B 07/03/22, variabel	2.990.250	0,24
6.500.000	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variabel	6.473.025	0,52
1.750.000	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variabel	1.742.738	0,14
4.700.000	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	4.671.330	0,38
3.750.000	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	3.751.875	0,30
603.000	ILN SAC 10/02/21, ZCP	621.331	0,05
5.000.000	Integrity Re 12/06/23, variabel	4.969.750	0,40
9.750.000	Integrity Re II 12/04/23, variabel	10.019.344	0,81
15.825.000	Kilimanjaro II Re 20/04/21, variabel	15.878.013	1,28
4.250.000	Kilimanjaro II Re Series A-1 20/04/21, variabel	4.275.288	0,34
4.750.000	Kilimanjaro II Re 21/04/22, variabel	4.783.963	0,38
2.850.000	Kilimanjaro II Re Series * 21/04/22, variabel	2.857.838	0,23
2.350.000	Kilimanjaro II Re Series **21/04/22, variabel	2.363.983	0,19
5.250.000	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/23, variabel	5.249.213	0,42
10.250.000	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	10.304.838	0,83

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
5.250.000	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	5.215.613	0,42	7.000.000	Sutter Re Series F 06/06/22, variabel	7.186.550	0,58
9.087.000	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	9.130.163	0,73	4.500.000	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	4.667.625	0,38
3.950.000	Kilimanjaro Re Series A1 06/05/22, variabel	3.975.873	0,32	6.250.000	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	6.472.188	0,52
13.350.000	Kilimanjaro Re Series B1 06/05/22, variabel	13.473.487	1,08	11.800.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	12.009.449	0,96
4.500.000	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel	4.534.425	0,36	11.400.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	11.541.929	0,93
14.350.000	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variabel	14.446.862	1,16	9.550.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	9.676.538	0,78
7.650.000	Kizuna Re II Series A 11/04/23, variabel	7.657.268	0,62	7.300.000	Voussoir Re 31/12/00, ZCP	7.729.970	0,62
1.750.000	Kizuna Re II Series B 11/04/23, variabel	1.751.313	0,14	Irland		9.386.435	0,75
1.750.000	Manatee Re III Series A 07/06/22, variabel	1.725.413	0,14	7.966.000	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	9.386.435	0,75
1.750.000	Manatee Re III Series B 07/06/22, variabel	1.737.838	0,14	Singapur		7.311.013	0,59
5.000.000	Merna Re 08/04/21, variabel	5.017.250	0,40	5.000.000	Alamo Re II 08/06/23, variabel	5.183.750	0,42
17.834.000	Merna Reinsurance II 07/04/22, variabel	17.851.833	1,44	2.250.000	Casablanca Re 07/06/21, ZCP	2.127.263	0,17
5.000.000	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variabel	5.088.750	0,41	Supranational		56.451.646	4,54
9.714.000	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variabel	9.886.424	0,80	15.450.000	International Bank for Reconstruction & Development 15/02/21, variabel	15.446.138	1,24
10.500.000	Nakama Re 14/01/21, variabel	10.555.125	0,85	16.400.000	International Bank for Reconstruction & Development 15/02/21, variabel	16.392.619	1,32
13.690.000	Nakama Re 14/01/25, variabel	13.631.132	1,09	4.445.000	International Bank for Reconstruction & Development 15/02/21, variabel	4.476.782	0,36
19.000.000	Northshore Re II 08/07/22, variabel	19.304.949	1,55	3.450.000	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variabel	3.456.555	0,28
10.500.000	Northshore Re II 07/07/23, variabel	10.712.625	0,86	6.150.000	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variabel	6.167.220	0,50
1.160.000	Riverfront Re 15/01/21, variabel	1.166.554	0,09	3.197.000	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variable	3.201.476	0,26
7.500.000	Sanders Re 06/12/21, variabel	7.426.125	0,60	550.000	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	550.000	0,04
2.800.000	Sanders Re 07/04/22, variabel	2.756.180	0,22	2.250.000	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	2.248.931	0,18
11.250.000	Sanders Re II 07/04/23, variabel	7.354.688	0,59				
5.270.000	Sanders Re II 07/06/23, variabel	5.393.055	0,43				
7.125.000	Sanders Re II 07/04/24, variabel	7.185.028	0,58				
5.950.000	Spectrum Capital 08/06/21, variabel	5.986.593	0,48				
4.500.000	Sutter Re Series A 06/06/22, variabel	4.623.075	0,37				

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
4.500.000	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4.511.925	0,36	3.400.000	Galilei Re Class A-2 08/01/21, variabel	3.354.950	0,27
Vereinigtes Königreich		1.769.863	0,14	4.800.000	Galilei Re Class B-2 08/01/21, variabel	4.753.200	0,38
1.750.000	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	1.769.863	0,14	14.400.000	Galilei Re Class C-2 08/01/21, variabel	14.454.000	1,16
Summe Anleihen		489.872.028	39,39	3.750.000	Galilei Re Class D-2 08/01/21, variabel	3.765.938	0,30
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		489.872.028	39,39	7.250.000	Galileo Re 06/11/20, variabel	7.288.063	0,59
				7.000.000	Herbie Re 08/07/24, variabel	7.198.100	0,58
				4.364.000	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	4.568.235	0,37
				3.379.000	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	3.544.571	0,29
				4.950.000	Integrity Re 10/06/22, variabel	4.875.502	0,39
Anleihen				16.775.000	Kendall Re 06/05/21, variabel	16.854.681	1,36
Bermuda		412.199.538	33,15	12.707.000	Kilimanjaro II Re Series * 20/04/21, variabel	12.767.358	1,03
11.904.711	Akibare Re 07/04/23, variabel	28.274	-	900.000	Loma Reinsurance 08/01/21, variabel	216.000	0,02
16.700.000	Aozora Re 07/04/21, variabel	16.783.499	1,35	15.000.000	Manatee Re II 07/06/21, variabel	15.023.249	1,21
3.250.000	Armor Re II 08/06/22, variabel	3.280.387	0,26	3.000.000	Manatee Re II Series B 07/06/21, variabel	2.976.450	0,24
9.530.000	Bonanza Re 20/02/24, variabel	9.570.503	0,77	23.250.000	Matterhorn Re Series A 07/12/20, ZCP	23.137.237	1,87
6.750.000	Cal Phoenix Re 13/08/21, variabel	2.363	-	7.000.000	Matterhorn Re Series C 07/12/20, ZCP	6.833.750	0,55
7.500.000	Cape Lookout Re 09/05/22, variabel	7.650.375	0,62	6.500.000	Matterhorn Re 07/12/21, variabel	6.651.125	0,53
5.485.642	Citrus Re 25/02/21, variabel	991.256	0,08	3.750.000	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	3.769.500	0,30
2.166.695	Citrus Re 20/03/23, variabel	662.575	0,05	10.000.000	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variabel	10.031.500	0,81
2.700.000	Designated as Randolph Re 2020-1 06/07/21, ZCP	2.511.810	0,20	3.500.000	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variabel	3.553.375	0,29
16.500.000	Everglades Re II 04/05/21, variabel	16.525.574	1,33	7.500.000	Matterhorn Re Series B 07/12/21, ZCP	6.798.375	0,55
6.500.000	Everglades Re II 04/05/23, variabel	6.647.875	0,53	8.000.000	Matterhorn Re Series B 07/12/21, variabel	8.048.400	0,65
8.925.000	First Coast Re 2017-1 07/06/21, variabel	9.062.891	0,73	7.250.000	Matterhorn Re Series B* 07/12/21, variabel	7.284.800	0,59
11.650.000	FloodSmart Re Series A 06/08/21, variabel	11.719.318	0,94	10.500.000	Merna Reinsurance II 07/04/23, variabel	10.600.800	0,85
7.400.000	FloodSmart Re Series B 06/08/21, variabel	7.361.150	0,59	6.000.000	MetroCat Re 08/05/23, variabel	6.135.600	0,49
8.800.000	Fortius Re II 07/07/21, variabel	8.849.720	0,71	7.500.000	Nakama Re 14/01/21, variabel	7.533.375	0,61
2.500.000	Frontline Re Series A 06/07/22, variabel	1.025.000	0,08	1.250.000	Nakama Re 13/10/21, variabel	1.251.063	0,10
4.371.483	Frontline Re Series B 06/07/22, variabel	662.280	0,05				

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
7.500.000	Nakama Re 144A 13/10/21, variabel	7.524.375	0,61	7.625.000	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variabel	7.645.206	0,61
17.825.000	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	17.767.068	1,44	3.750.000	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variabel	3.720.938	0,30
11.950.000	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	11.888.458	0,95	2.250.000	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variabel	2.232.563	0,18
3.022.000	Pelican IV Re 07/05/21, variabel	3.033.333	0,24	5.812.000	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	5.857.043	0,47
3.000.000	SD Re 19/10/21, variabel	2.868.750	0,23	6.154.000	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6.225.079	0,50
2.250.000	Sierra Series A 28/12/22, variabel	2.280.038	0,18	8.200.000	Vita Capital VI 08/01/21, variabel	7.000.750	0,56
2.750.000	Sierra Series B 28/12/22, variabel	2.785.888	0,22	1.050.000	Vitality Re IX Series A 10/01/22, variabel	1.048.688	0,08
11.450.000	Ursa Re 24/09/21, variabel	11.478.053	0,92	1.900.000	Vitality Re IX Series B 10/01/22, variabel	1.893.825	0,15
20.732.000	Ursa Re 10/12/22, variabel	20.797.305	1,68	850.000	Vitality Re VIII Series A 08/01/21, variabel	848.088	0,07
4.150.000	Ursa Re Series C 10/12/20, variabel	4.161.413	0,33	2.100.000	Vitality Re VIII Series B 08/01/21, variabel	2.090.025	0,17
14.450.000	Ursa Re Series D 10/12/20, variabel	14.488.293	1,16	5.250.000	Vitality Re X Series A 10/01/23, variabel	5.240.813	0,42
5.519.000	Windmill II Re 05/07/24, variabel	6.522.517	0,52	2.250.000	Vitality Re X Series B 10/01/23, variabel	2.241.562	0,18
Kaimaninseln		114.227.415	9,19	9.117.000	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	9.091.928	0,73
5.462.500	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	4.991.359	0,41	3.500.000	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3.485.125	0,28
6.600.000	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	41.250	-	Irland		43.321.198	3,48
132.536	Caelus Re V Series D 05/06/24, variabel	1.352	-	10.000.000	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	10.321.500	0,83
2.000.000	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	2.016.600	0,17	1.739.498	Atlas IX Capital DAC 07/01/21, variabel	1.704.707	0,14
2.750.000	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	2.754.125	0,22	7.856.000	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	9.302.875	0,75
500.000	Long Point Re III 01/06/22, variabel	501.925	0,04	4.100.000	Hexagon Reinsurance DAC Series A 19/01/22, variabel	4.728.450	0,38
6.300.000	Residential Reinsurance 2016 Class 3 06/12/20, variabel	6.335.595	0,51	3.750.000	Hexagon Reinsurance DAC Series B 19/01/22, variabel	4.334.474	0,35
2.550.000	Residential Reinsurance 2016 Class 4 06/12/20, variabel	2.560.073	0,21	11.000.000	Lion II Re DAC 15/07/21, variabel	12.929.192	1,03
4.750.000	Residential Reinsurance 2017 Series 11 06/06/21, variabel	4.859.725	0,39	Singapur		6.098.700	0,49
6.150.000	Residential Reinsurance 2017 Series 13 06/06/21, variabel	6.185.977	0,50	6.000.000	Catahoula Re 09/05/23, variabel	6.098.700	0,49
10.050.000	Residential Reinsurance 2017 06/12/21, variabel	10.052.512	0,81	Vereinigtes Königreich		25.714.429	2,07
15.400.000	Residential Reinsurance 2018 Series 13 06/06/22, variabel	15.305.289	1,23	25.775.000	Atlas Capital UK 2018 07/06/22, variabel	25.714.429	2,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten		9.587.700	0,77
9.540.000	Chesterfield Financial Holdings 15/12/34, 4,50%	9.587.700	0,77
Summe Anleihen		611.148.980	49,15
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		611.148.980	49,15

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigte Staaten		20.224.228	1,63
15.483.903	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96%	16.940.357	1,36
2.955.779	LionRock SideCar 2020-1C 31/12/00, ZCP	3.283.871	0,27
Summe Anleihen		20.224.228	1,63
Summe sonstige Wertpapiere		20.224.228	1,63
Summe Kapitalanlagen		1.121.245.236	90,17
Sonstiges Nettovermögen		122.197.572	9,83
Nettoinventarwert		1.243.442.808	100,00

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Vereinigte Staaten		223.112.523	97,30
821.209	ADT	6.709.278	2,93
290.117	Altice USA	7.543.042	3,29
22.620	Bill.com Holdings	2.269.012	0,99
77.426	Blackbaud	4.322.694	1,89
270.796	Cargurus	5.857.317	2,55
274.410	Cornerstone OnDemand	9.977.548	4,35
204.499	DISH Network	5.936.606	2,59
41.577	Duck Creek Technologies	1.888.843	0,82
121.643	EchoStar	3.027.694	1,32
26.979	FARO Technologies	1.645.179	0,72
171.668	Green Dot	8.688.117	3,79
142.500	GrubHub	10.307.025	4,50
7.850	Guidewire Software	818.520	0,36
56.360	Madison Square Garden Sports	8.481.053	3,70
221.561	Marvell Technology Group	8.795.972	3,84
161.690	New Relic	9.112.848	3,97
781.658	News	10.958.845	4,78
599.275	NortonLifeLock	12.488.891	5,45
635.389	Nuance Communications	21.088.561	9,19
87.733	Qorvo	11.318.434	4,93
36.690	RingCentral	10.075.441	4,39
36.812	Splunk	6.925.442	3,02
34.749	Stitch Fix	942.740	0,41
204.560	Trimble	9.962.072	4,34
4.176	Wayfair	1.215.258	0,53
82.306	Workday	17.706.490	7,72
111.956	World Wrestling Entertainment	4.530.859	1,98
201.976	Zillow Group	20.518.742	8,95
Summe Aktien		223.112.523	97,30
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		223.112.523	97,30
Summe Kapitalanlagen		223.112.523	97,30
Sonstiges Nettovermögen		6.182.927	2,70
Nettoinventarwert		229.295.450	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
Aktien			
Kanada		46.560.975	4,59
179.459	Canadian Pacific Railway	46.560.975	4,59
China		128.169.709	12,62
1.485.472	Alibaba Group Holding	45.055.192	4,44
131.390	Alibaba Group Holding - ADR	32.944.716	3,24
293.137	Meituan Dianping	7.800.602	0,77
752.668	Tencent Holdings	42.369.199	4,17
Deutschland		28.716.028	2,83
372.197	Porsche Automobil Holding	18.944.827	1,87
71.115	Volkswagen	9.771.201	0,96
Irland		2.058.408	0,20
15.268	Flutter Entertainment	2.058.408	0,20
Japan		34.500.550	3,40
261.200	Asahi Group Holdings	7.722.833	0,76
55.500	Nintendo	26.777.717	2,64
Russland		12.284.442	1,21
220.734	Yandex	12.284.442	1,21
Taiwan		29.176.280	2,87
421.953	Taiwan Semiconductor Manufacturing	29.176.280	2,87
Vereinigtes Königreich		22.635.399	2,23
111.447	Linde	22.635.399	2,23
Vereinigte Staaten		671.311.590	66,11
75.606	Activision Blizzard	5.220.100	0,51
20.527	Alphabet	25.729.438	2,53
13.620	Amazon.com	36.577.852	3,60
104.388	Blackstone Group	4.647.579	0,46
221.595	Blackstone Mortgage Trust	4.152.367	0,41
8.610	Booking Holdings	12.562.544	1,24
7.000	Boston Beer	5.274.016	0,52
130.214	Charter Communications	69.340.106	6,83
677.554	Comcast	26.733.462	2,63
621.681	DR Horton	40.102.123	3,95
114.307	eBay	5.079.445	0,50
227.658	Facebook	50.853.878	5,01
101.237	Fiserv	8.898.011	0,88
167.101	Global Payments	25.309.221	2,49

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
406.277	KKR	11.899.486	1,17
808.042	L Brands	21.923.166	2,16
53.800	Martin Marietta Materials	10.799.922	1,06
81.977	Mastercard	23.644.643	2,33
175.867	Match Group	16.597.453	1,63
232.379	Microsoft	41.687.300	4,11
54.118	Netflix	23.080.407	2,27
1.136	NVR	3.956.181	0,39
205.817	PayPal Holdings	34.587.508	3,41
134.250	Progressive	10.840.076	1,07
442.567	T-Mobile US	43.167.692	4,25
40.235	Tractor Supply	4.919.003	0,48
176.596	Union Pacific	29.652.825	2,92
138.534	UnitedHealth Group	36.838.027	3,63
121.861	Visa	20.784.293	2,05
142.326	Vulcan Materials	16.453.466	1,62
Summe Aktien		975.413.381	96,06
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		975.413.381	96,06
Summe Kapitalanlagen		975.413.381	96,06
Sonstiges Nettovermögen		40.040.424	3,94
Nettoinventarwert		1.015.453.805	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Brasilien		7.443.378	1,84
19.379	Banco Bradesco	66.470	0,02
603.030	Duratex	1.925.306	0,48
10.266	Itau Unibanco Holding	40.859	0,01
1.028.600	Itausa	1.611.795	0,40
149.798	Lojas Americanas	757.272	0,19
128.392	Lojas Renner	906.487	0,22
499.500	Raia Drogasil	2.083.067	0,51
4.952	Vale	52.122	0,01
Chile		1.567.016	0,39
208.935	Empresas COPEC	1.567.016	0,39
China		14.664.488	3,63
106.500	Baozun	1.113.090	0,28
143.400	Budweiser Brewing	416.320	0,10
32.300	Chacha Food	276.164	0,07
307.300	China Jushi	654.133	0,16
38.000	China Tourism Group Duty Free	1.248.845	0,30
40.000	CNOOC	38.451	0,01
61.700	Fujian Star-net Communication	231.205	0,06
183.995	Gree Real Estate	298.356	0,07
64.283	Hongfa Technology	432.966	0,11
149.980	Huayu Automotive Systems	550.515	0,14
100.823	Huizhou Desay Sv Automotive	1.055.991	0,26
44.778	Jiangsu Hengli Hydraulic	471.302	0,12
312.779	Midea Group	3.347.425	0,82
50.247	Oppein Home Group	798.260	0,20
29.580	Oppl Lighting	114.681	0,03
14.600	Poly Property Services	113.220	0,03
10.960	Quectel Wireless Solutions	321.062	0,08
57.453	Shandong Sinocera Functional Material	314.636	0,08
51.404	Shanghai Kelai Mechatronics Engineering	304.166	0,08
29.200	Tongcheng-Elong Holdings	53.125	0,01
173.112	Venustech Group	881.171	0,22
114.688	Winning Health Technology Group	328.663	0,08

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
19.180	Wuhan Raycus Fiber Laser Technologies	175.835	0,04
62.600	Wuxi Lead Intelligent Equipment	446.546	0,11
597.400	XCMG Construction Machinery	488.759	0,12
9.447	XPeng	189.601	0,05
Tschechische Republik		563.196	0,14
244.328	Moneta Money Bank	563.196	0,14
Ägypten		686.250	0,17
159.593	Commercial International Bank Egypt	686.250	0,17
Georgien		1.964.783	0,49
141.583	Georgia Capital	667.738	0,17
99.131	TBC Bank Group	1.297.045	0,32
Griechenland		1.399.064	0,35
96.936	Hellenic Telecommunications Organization	1.399.064	0,35
Ungarn		2.856.638	0,71
57.317	OTP Bank	1.726.832	0,43
53.474	Richter Gedeon	1.129.806	0,28
Indonesien		2.006.638	0,50
1.101.800	Bank Central Asia	2.006.638	0,50
Italien		2.758.286	0,68
640	Amplifon	22.924	0,01
2.261	DiaSorin	455.691	0,11
41.369	FinecoBank Banca Fineco	570.153	0,15
21.950	GVS	295.956	0,07
301.944	Intesa Sanpaolo	567.485	0,14
7.330	Moncler	300.620	0,07
18.729	Prysmian	545.457	0,13
Japan		1.305.078	0,32
12.400	GMO Financial Gate	1.305.078	0,32
Kasachstan		2.719.136	0,67
230.736	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	2.468.875	0,61
37.013	KAZ Minerals	250.261	0,06
Kenia		1.095.816	0,27
3.989.800	Safaricom	1.095.816	0,27
Luxemburg		70.349	0,02
3.736	Ternium	70.349	0,02
Mexiko		87.153	0,02
36.360	Corp Moctezuma SAB de CV	87.153	0,02

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Norwegen		33.171	0,01
52.000	Aker Carbon Capture	33.171	0,01
Peru		81.011	0,02
166.817	Ferreycorp SAA	81.011	0,02
Philippinen		1.219.943	0,30
678.520	Ayala Land	415.677	0,10
795.730	Puregold Price Club	804.266	0,20
Polen		10.003.788	2,48
15.400	CD Projekt	1.666.932	0,41
38.991	Grupa Lotos	347.907	0,09
49.244	KGHM Polska Miedz	1.503.283	0,37
37.540	KRUK	1.274.188	0,32
1.330	LPP	2.260.595	0,55
212.605	PGE Polska Grupa Energetyczna	353.113	0,09
306.753	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	1.683.197	0,42
47.301	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	303.356	0,08
16.568	Santander Bank Polska	611.217	0,15
Russland		40.425.708	10,00
815.465	Gazprom	3.550.535	0,88
67.412	HeadHunter Group	1.650.246	0,41
107.060	LUKOIL	6.196.632	1,53
142.361	Magnit	2.124.026	0,53
87.717	MMC Norilsk Nickel	2.118.366	0,52
32.045	Novatek	4.390.165	1,09
137.689	Polymetal International	3.001.684	0,74
9.775	Polyus	1.030.285	0,25
192.046	Rosneft Oil	944.290	0,23
613.940	Sberbank of Russia	7.173.888	1,78
180.167	TCS Group Holding	4.765.416	1,18
49.001	X5 Retail Group	1.813.037	0,45
25.550	Yandex	1.667.138	0,41
Slowenien		2.367.660	0,59
272.158	Nova Ljubljanska Banka dd	2.367.660	0,59
Südafrika		2.725.705	0,67
17.610	Capitec Bank Holdings	1.090.643	0,27
44.164	FirstRand	108.709	0,03
13.006	Foschini Group	63.671	0,02
8.277	Naspers	1.462.682	0,35

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Südkorea		18.309.762	4,53
7.302	Hyundai Mobis	1.436.050	0,36
1.955	KB Financial Group	62.771	0,02
3.326	Korea Zinc	1.070.747	0,26
2.472	LG Chem	1.382.375	0,34
4.760	NAVER	1.206.789	0,30
123.888	Samsung Electronics	6.165.268	1,52
122.624	Samsung Electronics - Preference	5.295.008	1,31
6.697	Samsung Fire & Marine Insurance	1.042.201	0,26
271	Samsung SDI	100.452	0,02
7.631	SK Hynix	548.101	0,14
Schweiz		2.098.982	0,52
44.953	STMicroelectronics	1.383.510	0,34
17.806	Wizz Air Holdings	715.472	0,18
Taiwan		24.489.506	6,06
40.792	Advantech	409.864	0,10
37.000	Asustek Computer	323.855	0,08
107.000	Chroma ATE	565.258	0,14
23.250	Dadi Early-Childhood Education Group	144.098	0,04
159.000	Getac Technology	250.616	0,06
116.000	MediaTek	2.431.186	0,60
30.000	Merida Industry	241.351	0,06
54.000	Novatek Microelectronics	495.028	0,12
7.000	Parade Technologies	253.781	0,06
60.000	PChome Online	208.204	0,05
10.000	Realtek Semiconductor	127.236	0,03
232.651	Taiwan Cement	332.565	0,08
1.157.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	17.297.872	4,29
65.000	Universal Vision Biotechnology	590.256	0,15
107.000	Vanguard International Semiconductor	355.041	0,09
13.650	Voltronic Power Technology	463.295	0,11
Thailand		401.919	0,10
165.400	Kasikornbank	401.919	0,10
Türkei		11.327.092	2,80
776.342	Arcelik	2.493.060	0,62
2.207.033	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	2.703.510	0,66

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
102.462	Ford Otomotiv Sanayi	1.160.911	0,29
240.897	Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret	1.199.689	0,30
214.331	Migros Ticaret	1.143.432	0,28
488.898	MLP Saglik Hizmetleri	1.093.298	0,27
984.244	Sok Marketler Ticaret	1.533.192	0,38
Vereinigtes Königreich		3.235.522	0,80
7.291	Arena Events Group	532	-
179.982	Avast	1.223.904	0,31
43.042	CNH Industrial	335.489	0,08
150.642	Equals Group	46.165	0,01
66.355	Primary Health Properties	127.062	0,03
37.559	Secure Trust Bank	306.294	0,08
78.210	SiS Science in Sport	37.340	0,01
194.733	TT Electronics	502.547	0,12
151.350	Watches of Switzerland Group	656.189	0,16
Vereinigte Staaten		7.254.785	1,79
8.000	IAC/InterActiveCorp	958.240	0,24
5.393	Mastercard	1.823.751	0,45
17.200	Match Group	1.903.180	0,47
12.850	Visa	2.569.614	0,63
Summe Aktien		165.161.823	40,87
Anleihen			
Brasilien		98.253	0,02
466.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	98.253	0,02
Kolumbien		141.601	0,04
157.000.000	Colombian TES 18/09/30, 7.75%	47.438	0,01
329.000.000	Colombian TES 18/10/34, 7.25%	94.163	0,03
Ägypten		59.879	0,01
850.000	Egypt Government Bond 09/05/27, 17.18%	59.879	0,01
Indonesien		393.544	0,10
2.100.000.000	Indonesia Treasury Bond 15/09/30, 7.00%	142.082	0,04
2.350.000.000	Indonesia Treasury Bond 15/05/38, 7.50%	157.377	0,04
1.260.000.000	Indonesia Treasury Bond 15/02/44, 8.75%	94.085	0,02
Elfenbeinküste		106.473	0,03
100.000	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	106.473	0,03

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Mexico		428.153	0,10
1.900.000	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	100.799	0,02
2.000.000	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	98.019	0,02
1.050.000	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	52.521	0,01
1.300.000	Petroleos Mexicanos 12/09/24, 7.19%	51.089	0,01
3.500.000	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	125.725	0,04
Südafrika		228.325	0,06
1.560.000	Republic of South Africa Government Bond 31/01/30, 8.00%	85.109	0,02
940.000	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	48.192	0,01
1.900.000	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	95.024	0,03
Supranational		98.933	0,02
7.120.000	International Finance 25/11/24, 6.30%	98.933	0,02
Summe Anleihen		1.555.161	0,38
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		166.716.984	41,25

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Ghana		159.852	0,04
500.000	Republic of Ghana Government Bonds 25/07/22, 18.25%	86.397	0,02
440.000	Republic of Ghana Government Bonds 02/11/26, 19.00%	73.455	0,02
Ukraine		85.161	0,02
1.000.000	Ukraine Government Bond 26/02/25, 15.84%	40.229	0,01
1.390.000	Ukraine Government Bond 26/05/27, 9.79%	44.932	0,01
Vereinigte Staaten		175.086.810	43,32
92.000	JBS USA LUX/JBS USA Finance 15/02/28, 6.75%	100.162	0,03
15.000.000	United States Treasury Bill 01/10/20, ZCP	15.000.000	3,71

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
20.000.000	United States Treasury Bill 08/10/20, ZCP	19.999.681	4,95
20.000.000	United States Treasury Bill 15/10/20, ZCP	19.999.362	4,95
20.000.000	United States Treasury Bill 22/10/20, ZCP	19.999.020	4,95
25.000.000	United States Treasury Bill 29/10/20, ZCP	24.998.444	6,18
10.000.000	United States Treasury Bill 05/11/20, ZCP	9.999.076	2,47
15.000.000	United States Treasury Bill 12/11/20, ZCP	14.998.303	3,71
15.000.000	United States Treasury Bill 19/11/20, ZCP	14.998.214	3,71
20.000.000	United States Treasury Bill 03/12/20, ZCP	19.997.042	4,95
15.000.000	United States Treasury Bill 10/12/20, ZCP	14.997.506	3,71
Summe Anleihen		175.331.823	43,38
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		175.331.823	43,38

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Hongkong		3.061.748	0,76
8.456	Schroder Umbrella Fund II - China Equity Alpha Fund	3.061.748	0,76
Luxemburg		23.349.398	5,77
15.617	Schroder ISF Indian Equity	3.974.325	0,98
181.249	Schroder ISF Securitised Credit	19.375.073	4,79
Summe Aktien		26.411.146	6,53
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen		26.411.146	6,53
Summe Kapitalanlagen		368.459.953	91,16
Sonstiges Nettovermögen		35.728.581	8,84
Nettoinventarwert		404.188.534	100,00

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Finnland		4.741.684	0,96
1.212.707	Nokia	4.741.684	0,96
Frankreich		15.344.987	3,09
157.136	Airbus	11.435.411	2,30
39.490	Safran	3.909.576	0,79
Spanien		23.304.301	4,69
382.242	Cellnex Telecom	23.304.301	4,69
Schweden		4.987.366	1,00
454.478	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	4.987.366	1,00
Vereinigtes Königreich		9.595.655	1,93
13.510	Linde	3.217.136	0,65
17.173	London Stock Exchange Group	1.966.849	0,40
3.329.735	Vodafone Group	4.411.670	0,88
Vereinigte Staaten		384.776.505	77,51
16.922	3M	2.710.566	0,55
190.581	Abbott Laboratories	20.740.931	4,17
2.208	Adobe	1.082.869	0,22
61.064	Analog Devices	7.128.611	1,44
27.673	AptarGroup	3.132.584	0,63
25.551	Arthur J Gallagher	2.697.675	0,54
43.828	Autodesk	10.124.706	2,04
147.595	AZEK	5.137.782	1,03
22.241	Ball	1.848.672	0,37
31.172	Bank of America	750.933	0,15
45.049	Berry Global Group	2.176.768	0,44
127.941	BJ's Wholesale Club Holdings	5.315.949	1,07
255.579	Boston Scientific	9.765.674	1,97
133.664	Brunswick	7.874.146	1,59
27.357	CarMax	2.514.382	0,51
33.753	Centene	1.968.812	0,40
3.461	Chevron	249.192	0,05
59.836	ConocoPhillips	1.965.014	0,40
57.357	Constellation Brands	10.869.725	2,19
14.395	Copart	1.513.778	0,30
227.633	Covetrus	5.554.245	1,12
25.448	Crown Holdings	1.955.933	0,39
18.572	Danaher	3.999.109	0,81

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
89.199	DR Horton	6.746.120	1,36
579.905	Dropbox	11.168.970	2,25
3.067	Ecolab	612.909	0,12
47.797	Electronic Arts	6.233.207	1,26
107.625	Eli Lilly	15.930.653	3,21
20.621	FMC	2.183.970	0,44
21.728	Garmin	2.061.118	0,42
41.588	General Mills	2.565.148	0,52
55.035	Graphic Packaging Holding	775.443	0,16
69.525	Hasbro	5.751.108	1,16
79.315	HCA Healthcare	9.888.994	1,99
36.860	HEICO	3.268.008	0,66
20.194	IQVIA Holdings	3.183.180	0,64
877.684	KeyCorp	10.470.770	2,11
101.372	Keysight Technologies	10.013.526	2,02
209.439	Las Vegas Sands	9.772.424	1,97
103.926	Lowe's	17.237.167	3,47
58.899	MasTec	2.485.538	0,50
36.099	Medtronic	3.751.408	0,76
13.367	Micron Technology	627.714	0,13
22.400	Microsoft	4.711.392	0,95
7.902	Moody's	2.290.395	0,46
19.746	Otis Worldwide	1.232.545	0,25
22.964	Parsley Energy	214.943	0,04
61.958	PayPal Holdings	12.207.585	2,46
87.743	Perspecta	1.706.601	0,34
424.797	Pfizer	15.590.050	3,14
81.310	PTC	6.725.963	1,35
10.070	Qorvo	1.299.131	0,26
155.638	Qualcomm	18.315.481	3,68
25.367	Roper Technologies	10.022.755	2,02
7.319	S&P Global	2.639.231	0,53
411.157	Sabre	2.676.632	0,54
24.695	SEI Investments	1.252.530	0,25
11.857	Sherwin-Williams	8.261.246	1,66
133.526	Southwest Airlines	5.007.225	1,01
63.062	Synovus Financial	1.335.023	0,27
33.696	TJX	1.875.182	0,38
58.793	Toro	4.935.672	0,99
28.661	TPI Composites	830.023	0,17
64.177	Tradeweb Markets	3.722.266	0,75

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
158.024	Umpqua Holdings	1.678.215	0,34
43.275	Union Pacific	8.519.549	1,72
233.233	Valvoline	4.440.756	0,89
53.467	Varonis Systems	6.171.161	1,24
494.505	Verra Mobility	4.776.918	0,96
12.090	Vulcan Materials	1.638.679	0,33
37.238	Waste Connections	3.865.304	0,78
58.445	Williams-Sonoma	5.285.766	1,06
141.904	World Wrestling Entertainment	5.742.855	1,16
Summe Aktien		442.750.498	89,18
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		442.750.498	89,18

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigte Staaten			
		18.445.098	3,72
9.999.000	American Airlines Group 01/06/22, 5.00%	6.824.318	1,37
4.875.000	American Airlines Group 01/03/25, 3.75%	2.480.156	0,50
5.073.000	NCL 15/05/24, 12.25%	5.688.101	1,15
4.919.000	NCL 15/12/24, 3.63%	3.452.523	0,70
Summe Anleihen		18.445.098	3,72
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		18.445.098	3,72
Summe Kapitalanlagen		461.195.596	92,90
Sonstiges Nettovermögen		35.233.533	7,10
Nettoinventarwert		496.429.129	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Deutschland		122.441	0,01
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	22.066	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	23.783	0,01
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	20.916	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	19.456	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	19.950	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	16.270	-
Vereinigte Staaten		38.136	0,00
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	12.338	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	13.419	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	12.379	-
Summe Anleihen		160.577	0,01
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		160.577	0,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Österreich		274.781.669	19,12
75.000.000	Austrian Treasury Bill 12/02/21, ZCP	74.947.010	5,22
100.000.000	Austrian Treasury Bill 22/02/21, ZCP	99.922.078	6,95
25.000.000	Austrian Treasury Bill 18/03/21, ZCP	24.979.018	1,74
75.000.000	Austrian Treasury Bill 18/03/21, ZCP	74.933.563	5,21

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Deutschland		254.776.875	17,73
135.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 01/02/21, ZCP	134.907.750	9,39
75.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 22/02/21, ZCP	74.931.000	5,21
45.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/03/21, ZCP	44.938.125	3,13
Vereinigte Staaten		249.978.592	17,39
65.000.000	United States Treasury Bill 20/10/20, ZCP	64.997.599	4,52
100.000.000	United States Treasury Bill 29/10/20, ZCP	99.988.333	6,96
85.000.000	United States Treasury Bill 28/01/21, ZCP	84.953.640	5,91
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	13.169	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	13.465	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	12.386	-
Summe Anleihen		779.537.136	54,24
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		779.537.136	54,24

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Luxemburg		5.000.000	0,35
5.000.000	JPMorgan Liquidity Funds - US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0,35
Summe Aktien		5.000.000	0,35
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen		5.000.000	0,35
Summe Kapitalanlagen		784.697.713	54,60
Sonstiges Nettovermögen		652.441.850	45,40
Nettoinventarwert		1.437.139.563	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert GBP	% des Nettovermögens
Aktien			
Vereinigtes Königreich		24.388.631	45,81
67.404	AB Dynamics	1.250.344	2,35
1.871.482	Arena Events Group	105.739	0,20
854.571	Calisen	1.413.460	2,66
434.612	Codemasters Group Holdings	1.586.334	2,97
1.296.958	Comptoir Group	40.854	0,08
540.594	Creo Medical Group	908.198	1,71
86.543	DiscoverIE Group	527.912	0,99
622.004	Equals Group	147.726	0,28
668.432	Everyman Media Group	497.982	0,94
84.875	GB Group	595.823	1,12
488.407	Hollywood Bowl Group	659.349	1,24
261.447	IG Design Group	1.108.535	2,08
613.334	Johnson Service Group	552.001	1,04
18.218.869	MelodyVR Group	783.411	1,47
315.565	Midwich Group	1.101.322	2,07
577.361	Primary Health Properties	856.804	1,61
339.873	Quixant	382.357	0,72
5.062.092	Renold	549.237	1,03
675.093	Secure Income Real Estate Investment Trust	1.795.747	3,36
108.637	Secure Trust Bank	686.586	1,29
1.714.659	SiS Science in Sport	634.424	1,19
181.539	Tracsis	1.034.772	1,94
492.130	TT Electronics	984.260	1,85
177.713	Vitec Group	1.325.739	2,49
117.276	Vp	751.739	1,41
208.088	WANdisco	950.962	1,79
376.198	Watches of Switzerland Group	1.264.025	2,37
618.775	Wincanton	1.243.738	2,34
60.950	Young & Company's Brewery	353.510	0,66
34.793	Young & Company's Brewery Class A	295.741	0,56
Summe Aktien		24.388.631	45,81

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert GBP	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigtes Königreich		17.129.252	32,18
2.800.000	United Kingdom Gilt 22/01/21, 1.50%	2.813.341	5,29
5.000.000	United Kingdom Gilt 07/09/21, 3.75%	5.176.922	9,72
4.200.000	United Kingdom Gilt 07/03/22, 4.00%	4.443.051	8,35
4.650.000	United Kingdom Gilt 22/07/22, 0.50%	4.695.938	8,82
Summe Anleihen		17.129.252	32,18
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		41.517.883	77,99

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert GBP	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigtes Königreich		7.399.711	13,90
2.300.000	United Kingdom Treasury Bill 23/11/20, ZCP	2.299.733	4,32
4.100.000	United Kingdom Treasury Bill 22/02/21, ZCP	4.100.000	7,70
1.000.000	United Kingdom Treasury Bill 08/03/21, ZCP	999.978	1,88
Summe Anleihen		7.399.711	13,90
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		7.399.711	13,90
Summe Kapitalanlagen		48.917.594	91,89
Sonstiges Nettovermögen		4.314.849	8,11
Nettoinventarwert		53.232.443	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien				35.237	Suncor Energy	430.949	0,08
Australien				190.049	Tourmaline Oil	2.322.179	0,42
7.234	AUB Group	86.010	0,02	373.167	Trican Well Service	322.288	0,06
79.773	Australia & New Zealand Banking Group	983.906	0,18	China			
4.738	Macquarie Group	405.772	0,07	4.235	Alibaba Group Holding	1.245.004	0,24
243	QBE Insurance Group	1.499	-	1.687	Baidu	213.557	0,04
322	Tyro Payments	821	-	263.800	Baoshan Iron & Steel	194.049	0,04
Österreich				1.091	BeiGene	312.506	0,06
13.444	BAWAG Group	485.482	0,09	3.672.591	China Cinda Asset Management	687.126	0,12
Belgien				31.959	China Gas Holdings	90.722	0,02
1.537	Galapagos	218.409	0,04	122.000	China Life Insurance	272.963	0,05
23.121	KBC Group	1.159.961	0,21	585.002	China Longyuan Power Group	365.341	0,07
Bermuda				1.800.164	China Machinery Engineering	369.322	0,07
3.564	Enstar Group	575.586	0,10	5.138	China Merchants Port Holdings	5.224	-
7.802	RenaissanceRe Holdings	1.324.312	0,24	786	China National Accord Medicines	5.353	-
10.334	Third Point Reinsurance	71.821	0,01	21.077	China Traditional Chinese Medicine Holdings	8.811	-
11.561	Triton International	470.186	0,09	502.832	China Unicom Hong Kong	327.650	0,06
Brasilien				49.872	China Yangtze Power	1.296.920	0,24
130	BR Properties	208	-	102.800	China Yangtze Power Class A	289.898	0,05
31.442	Notre Dame Intermédica Participações	364.255	0,07	128.399	CNOOC	123.428	0,02
Britische Jungferninseln				38.709	Cstone Pharmaceuticals	49.148	0,01
121.076	Atlas Mara	39.471	0,01	37.321	ENN Energy Holdings	406.435	0,07
Kanada				39.643	FIH Mobile	5.627	-
248.465	Advantage Oil & Gas	326.547	0,06	6.298	Fosun International	7.314	-
596.359	ARC Resources	2.664.816	0,47	2.125	Geely Automobile Holdings	4.223	-
9.470	Brookfield Asset Management	313.078	0,06	3.687	Great Wall Motor	4.677	-
59.465	Canadian Natural Resources	952.035	0,17	13.667	Guangzhou Automobile Group	11.374	-
1.515	Canadian Solar	53.177	0,01	133.215	Haier Electronics Group	481.290	0,09
3.200	Clementia Pharmaceuticals	-	-	1.362.466	Hope Education Group	416.648	0,08
17.530	Dollarama	671.947	0,12	137	Kingsoft Cloud Holdings	4.046	-
106.711	ECN Capital	405.511	0,07	468.603	Lifetech Scientific	117.906	0,02
715.960	Headwater Exploration	752.765	0,14	4.200	Ming Yuan Cloud Group Holdings	15.716	-
34.335	Intact Financial	3.676.530	0,66	4.845	SHENZHEN AIRPORT	6.099	-
255.399	Kelt Exploration	274.282	0,05	6.200	Tencent Holdings	409.197	0,07
19.907	MEG Energy	41.412	0,01	40.480	Venustech Group	206.050	0,04
4.523	Parex Resources	47.657	0,01	28.504	WuXi AppTec	409.352	0,07
51.509	Roxgold	66.149	0,01				
100.960	Seven Generations Energy	272.199	0,05				
992.283	Storm Resources	1.550.035	0,28				

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
17.000	WuXi Biologics	413.701	0,07
1.340	Wuxi Lead Intelligent Equipment	9.559	-
8.945	Zai Lab	743.956	0,13
Zypern		115.769	0,02
221.642	Bank of Cyprus Holdings	115.769	0,02
Dänemark		847.486	0,15
4.214	Ascendis Pharma	650.304	0,11
5.189	Zealand Pharma	197.182	0,04
Frankreich		6.919.615	1,25
66	Aéroports de Paris	6.605	-
47.283	ALD	439.061	0,08
31.331	AXA	579.516	0,11
123.399	Credit Agricole	1.081.043	0,20
181.819	Engie	2.434.443	0,43
7.234	Kaufman & Broad	287.523	0,05
6.569	Rubis	263.710	0,05
2.957	Schneider Electric	367.668	0,07
36.268	SUMME	1.243.992	0,22
2.628	Worldline	216.054	0,04
Deutschland		2.914.691	0,53
19.419	Brenntag	1.236.292	0,22
1.618	Deutsche Boerse	284.174	0,05
403	Fresenius SE KGaA	18.347	-
3.383	Rheinmetall	304.461	0,06
5.479	RWE	205.435	0,04
26.839	Talanx	865.982	0,16
Hongkong		2.611.180	0,47
182.456	AIA Group	1.786.881	0,32
479	ASM Pacific Technology	4.870	-
40.574	CK Asset Holdings	197.633	0,04
10.981	Hutchison China MediTech	354.686	0,06
55.203	New World Development	267.110	0,05
Indien		6.533.704	1,18
159.440	Axis Bank	915.948	0,17
110.640	Edelweiss Financial Services	88.326	0,02
47.647	Housing Development Finance	1.119.168	0,20
449.061	ICICI Bank	2.151.574	0,38
43.977	Kotak Mahindra Bank	755.024	0,14
678.012	Power Grid	1.494.236	0,27
1.383	Prestige Estates Projects	4.757	-
1.551	Sobha	4.671	-

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Indonesien		384.141	0,07
2.734.700	Paniest	128.649	0,02
20.774.500	Panin Financial	255.492	0,05
Irland		345.474	0,06
8.488	AerCap Holdings	213.813	0,04
36.108	Irish Continental Group	131.661	0,02
Israel		267.342	0,05
14.673	Tower Semiconductor	267.342	0,05
Italien		864.676	0,16
43.078	Nexi	864.676	0,16
Japan		3.440.140	0,62
54.400	Astellas Pharma	808.276	0,14
600	Axis	6.087	-
1.642	Bandai Namco Holdings	119.711	0,02
13.950	Daiichi Sankyo	427.104	0,08
11.200	Direct Marketing MiX	286.730	0,05
100	Mitsui Fudosan Logistics Park	475.987	0,09
756	Renesas Electronics	5.484	-
54.219	Shinsei Bank	665.239	0,12
14.800	Tokio Marine Holdings	645.522	0,12
Jersey, Kanalinseln		296.801	0,05
35.010	Sanne Group	296.801	0,05
Kasachstan		392.101	0,07
5.753	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	61.557	0,01
22.640	NAC Kazatomprom	330.544	0,06
Kenia		406.546	0,07
1.201.914	Equity Group Holdings	406.546	0,07
Luxemburg		867.787	0,16
21.089	Addiko Bank	183.465	0,03
18.059	ArcelorMittal	604.074	0,12
8.147	Tenaris	80.248	0,01
Macau		305.480	0,06
77.143	Sands China	297.123	0,06
5.240	Wynn Macau	8.357	-
Malaysia		7.162	-
6.279	Malaysia Airports Holdings	7.162	-
Mexiko		503.993	0,09
32.097	Fresnillo	495.754	0,09
710	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV	8.239	-
Niederlande		2.044.863	0,37
252	Adyen	464.607	0,08

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
3.688	Argenx	968.173	0,18
160.841	DP Eurasia	79.592	0,01
59.618	ING Groep	423.379	0,08
2.315	Koninklijke Philips	109.112	0,02
Norwegen		648.503	0,12
46.124	Equinor	648.503	0,12
Peru		669.050	0,12
5.396	Credicorp	669.050	0,12
Philippinen		86.200	0,02
571.676	Bloomberry Resorts	86.200	0,02
Portugal		279.272	0,05
94.522	CTT-Correios de Portugal	279.272	0,05
Puerto Rico		203.584	0,04
5.613	Popular	203.584	0,04
Singapur		436.108	0,08
29.900	DBS Group Holdings	436.108	0,08
Slowenien		297.595	0,05
34.208	Nova Ljubljanska Banka dd	297.595	0,05
Südafrika		637.977	0,12
240.473	FirstRand	591.922	0,11
16.654	Sibanye Stillwater	46.055	0,01
Südkorea		490.306	0,09
266	Big Hit Entertainment	30.705	0,01
42	CJ Logistics	6.375	-
31	Hyundai Motor	4.732	-
283	KB Financial Group	9.086	-
18.330	Shinhan Financial Group	432.585	0,08
95	SK Hynix	6.823	-
Spanien		1.427.141	0,26
2.195	Aena SME	307.022	0,06
2.977	Atlantica Sustainable Infrastructure	85.172	0,02
218.065	Banco Santander	408.970	0,07
7.378	Cellnex Telecom	449.818	0,08
4.785	Laboratorios Farmaceuticos Rovi	176.159	0,03
Schweden		932.009	0,17
9.808	Alfa Laval	217.716	0,04
12.931	Lundin Energy	257.729	0,05
29.053	Swedbank	456.564	0,08
Schweiz		2.775.799	0,50
983	Cembra Money Bank	116.758	0,02
34	Flughafen Zurich	4.673	-
95	LafargeHolcim	4.331	-
7.269	Novartis	630.656	0,11

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
3.653	Roche Holding	1.249.925	0,23
658	Tecan Group	327.911	0,06
39.484	UBS Group	441.545	0,08
Tansania		258.347	0,05
127.851	Helios Towers	258.347	0,05
Thailand		36.994	0,01
15.224	Kasikornbank	36.994	0,01
Vereinigte Arabische Emirate		662.039	0,12
187.800	Network International Holdings	662.039	0,12
Vereinigtes Königreich		8.087.728	1,47
93.455	Alpha Financial Markets Consulting	252.032	0,05
124	AstraZeneca	13.531	-
174.599	Babcock International Group	564.136	0,10
478.192	Barclays	602.289	0,11
349.228	Beazley	1.378.016	0,24
31.288	BP	546.288	0,10
8.099	Coca-Cola European Partners	314.322	0,06
153.404	ConvaTec Group	353.925	0,06
14.900	Freeline Therapeutics Holdings	232.589	0,04
1.969	Genus	97.919	0,02
8.750	Intermediate Capital Group	134.696	0,02
827	Linde	196.934	0,04
1.746.646	Lloyds Banking Group	593.985	0,11
21.743	National Grid	249.643	0,05
81.634	Provident Financial	204.353	0,04
27.871	Prudential	398.833	0,07
75.414	RSA Insurance Group	439.551	0,08
48.558	Segro	584.212	0,11
202.406	Serco Group	332.214	0,06
61.840	Standard Chartered	284.151	0,05
43.690	Subsea 7	314.109	0,06
Vereinigte Staaten		103.240.615	18,70
775	2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust	858.485	0,16
9.497	2U	321.568	0,06
3.365	Abbott Laboratories	366.213	0,07
1.563	Acadia Healthcare	46.077	0,01
8.126	Accelaron Pharma	914.419	0,17
7.333	Advanced Drainage Systems	457.873	0,08
4.841	Aerie Pharmaceuticals	56.979	0,01
6.199	Agilent Technologies	625.727	0,11

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
31.524	AGNC Investment	438.499	0,08	5.199	Boston Scientific	198.654	0,04
25.728	Akero Therapeutics	792.165	0,14	100.425	BowX Acquisition	1.030.361	0,19
872	Align Technology	285.458	0,05	48.663	Brigham Minerals	434.074	0,08
31.989	Alkermes	530.058	0,10	9.349	BRP	493.937	0,09
837	Alleghany	435.617	0,08	5.951	BWX Technologies	335.101	0,06
2.368	Allscripts Healthcare Solutions	19.276	-	9.843	Cabot Oil & Gas	170.874	0,03
8.877	Ally Financial	222.546	0,04	11.543	Cactus	221.510	0,04
888	Alnylam Pharmaceuticals	129.293	0,02	17.100	Caesars Entertainment	958.626	0,17
1.400	ALX Oncology Holdings	52.836	0,01	17.433	California Bancorporation	197.516	0,04
7.100	American Business Bank	161.170	0,03	100	Cavco Industries	18.031	0,00
22.728	American Electric Power	1.114.127	0,20	7.239	Centene	422.251	0,08
6.158	American Express	617.340	0,11	24.411	CenterPoint Energy	472.353	0,09
27.997	American International Group	770.757	0,14	4.439	Ceridian HCM Holding	366.883	0,07
1.254	American Tower	303.129	0,05	72.429	ChampionX	578.708	0,10
5.503	Amgen	1.398.642	0,25	27.683	Charles Schwab	1.002.955	0,18
21.729	Amicus Therapeutics	306.813	0,06	3.171	Chart Industries	222.826	0,04
18.238	Amneal Pharmaceuticals	70.763	0,01	296	Charter Communications	184.805	0,03
15.625	Apache	147.969	0,03	7.703	Chegg	550.302	0,10
31.767	Apellis Pharmaceuticals	958.410	0,17	17.854	Chevron	1.285.488	0,23
5.323	Archer-Daniels-Midland	247.466	0,04	4.244	Chubb	492.813	0,09
1.411	Arena Pharmaceuticals	105.529	0,02	86.505	Churchill Capital IV	866.780	0,16
35.985	Ares Management	1.454.515	0,27	64.726	Cimarex Energy	1.574.785	0,30
1.150	Ares Management - Preference	29.670	0,01	54.574	Citizens Financial Group	1.379.631	0,25
19.842	Artisan Partners Asset Management	773.640	0,14	43.339	CNX Resources	409.120	0,07
8.369	Assembly Biosciences	137.586	0,02	16.613	Coherus Biosciences	304.682	0,06
7.529	Assurant	913.343	0,17	41.102	Cohn Robbins Holdings	414.719	0,08
6.462	Assured Guaranty	138.804	0,03	9.644	Comfort Systems USA	496.762	0,09
8.647	Athene Holding	294.690	0,05	27.840	Community Bankers Trust	141.427	0,03
15.535	Atlantic Union Bankshares	331.983	0,06	17.124	Community West Bancshares	137.506	0,02
9.871	Atreca	137.898	0,02	6.745	Concho Resources	297.589	0,05
5.554	Avangrid	280.255	0,05	3.985	ConocoPhillips	130.867	0,02
12.711	Avidbank Holdings	167.785	0,03	2.501	Constellation Brands	473.965	0,09
6.432	Banc of California	65.092	0,01	16.243	Constellation Pharmaceuticals	329.083	0,06
28.270	Bank of America	681.024	0,12	4.858	Copart	510.867	0,09
13.505	Bank of New York Mellon	463.762	0,08	467	CoStar Group	396.254	0,07
1.673	Becton Dickinson	389.274	0,07	6.025	Danaher	1.297.363	0,24
196	Berkeley Lights	14.967	-	14.594	Diamondback Energy	439.571	0,08
171	Bio-Techne	42.362	0,01	7.212	Duke Energy	638.695	0,12
2.789	Black Diamond Therapeutics	84.311	0,02	6.300	Dyne Therapeutics	127.197	0,02
19.946	Blackstone Group	1.041.181	0,19	5.706	Edwards Lifesciences	455.453	0,08
5.992	Bluebird Bio	323.268	0,06	948	Eli Lilly	140.323	0,03
5.524	Blueprint Medicines	512.075	0,09	1.092	Encompass Health	70.958	0,01
6.100	Bonanza Creek Energy	114.680	0,02	13.114	EQT	169.564	0,03

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
101.656	Equitable Holdings	1.854.206	0,35	926	Insulet	219.082	0,04
22.493	Essent Group	832.466	0,15	9.156	Integra LifeSciences Holdings	432.346	0,08
12.855	Essential Properties Realty Trust	235.504	0,04	43.499	Ironwood Pharmaceuticals	391.274	0,07
575	Evans Bancorp	12.794	-	3.079	ITT	181.815	0,03
435	Fair Isaac	185.040	0,03	5.648	JPMorgan Chase	543.733	0,10
1.272	Fidelity National Information Services	187.251	0,03	3.807	Kemper	254.422	0,05
8.444	First Solar	558.993	0,10	11.469	Kodiak Sciences	679.079	0,12
2.676	First US Bancshares	17.742	-	5.900	Kymera Therapeutics	190.629	0,03
12.389	FirstEnergy	355.688	0,06	1.671	Legend Biotech	51.584	0,01
697	Five Below	88.519	0,02	1.273	Leidos Holdings	113.488	0,02
1.691	FleetCor Technologies	402.627	0,07	7.014	Lennar	572.904	0,10
7.178	Floor & Decor Holdings	536.914	0,10	13.860	Level One Bancorporation	216.216	0,04
3.900	Forma Therapeutics Holdings	194.376	0,04	2.090	LiveRamp Holdings	108.199	0,02
7.116	Fortive	542.310	0,10	5.549	LPL Financial Holdings	425.442	0,08
6.927	Freeport-McMoRan	108.338	0,02	113.910	Magnolia Oil & Gas	588.915	0,11
79.238	FTAC Olympus Acquisition	792.380	0,14	13.919	Marathon Petroleum	408.383	0,07
24.885	G1 Therapeutics	287.422	0,05	16.122	Marvell Technology Group	640.043	0,12
3.700	Generation Bio	114.367	0,02	150	Masimo	35.409	0,01
8.974	Gilead Sciences	567.067	0,10	1.647	Mastercard	556.966	0,10
7.440	Global Blood Therapeutics	410.242	0,07	77	Match Group	8.520	-
6.785	Global Payments	1.204.880	0,22	18.100	Medical Properties Trust	319.103	0,06
36.738	GlycoMimetics	112.786	0,02	28.500	Mersana Therapeutics	530.670	0,10
5.886	GoDaddy	447.159	0,08	70.934	MGIC Investment	628.475	0,11
1.405	Goldman Sachs Group	282.363	0,05	4.874	Mirati Therapeutics	809.328	0,15
7.800	Hamilton Lane	503.802	0,09	1.276	Molina Healthcare	233.559	0,04
10.342	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	437.156	0,08	11.885	Morgan Stanley	574.640	0,10
700	Harmony Biosciences Holdings	23.730	-	16.503	MVB Financial	263.553	0,05
11.239	Hartford Financial Services Group	414.270	0,08	33.705	Mylan	499.845	0,09
1.407	Health Catalyst	51.496	0,01	274	MyoKardia	37.354	0,01
13.640	Helmerich & Payne	199.826	0,04	22.709	Myovant Sciences	319.061	0,06
25.538	Heritage Commerce	169.955	0,03	27.448	Navigator Holdings	229.465	0,04
5.850	Hologic	388.850	0,07	8.534	NextCure	75.099	0,01
1.206	HubSpot	352.429	0,06	72.306	NexTier Oilfield Solutions	133.766	0,02
807	Humana	334.009	0,06	46.990	NMI Holdings	836.422	0,15
1.539	IDEXX Laboratories	604.996	0,11	44.870	Nurix Therapeutics	1.566.413	0,29
6.950	IHS Markit	545.645	0,10	32.465	Odonate Therapeutics	436.005	0,08
7.849	II-VI	318.355	0,06	17.266	Old Second Bancorp	129.409	0,02
141.246	ImmunoGen	508.486	0,09	5.039	Ollie's Bargain Outlet Holdings	440.157	0,08
4.338	Incyte	389.292	0,07	1.924	OneMain Holdings	60.125	0,01
14.690	Ingersoll Rand	522.964	0,09	6.109	ONEOK	158.712	0,03
				19.455	Oyster Point Pharma	410.695	0,07
				151.544	Parsley Energy	1.418.453	0,26

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
36.865	PDC Energy	456.942	0,08	24.606	Targa Resources	345.222	0,06
1.959	Peloton Interactive	194.411	0,04	788	Tetra Tech	75.254	0,01
9.566	Penn National Gaming	695.448	0,13	18.827	Theravance Biopharma	278.357	0,05
198	Penumbra	38.487	0,01	11.472	TJX	638.417	0,12
27.127	Pfizer	995.561	0,18	3.657	Trane Technologies	443.411	0,08
3.037	Pinnacle West Capital	226.408	0,04	13.486	Tricida	122.183	0,02
8.797	Pioneer Natural Resources	756.454	0,14	3.366	TriNet Group	199.671	0,04
31.500	PMV Pharmaceuticals	1.118.250	0,20	6.300	Twist Bioscience	478.611	0,09
5.936	Polaris	560.002	0,10	12.816	UGI	422.672	0,08
21.117	PPD	781.118	0,14	1.399	UnitedHealth Group	436.166	0,08
5.421	Q2 Holdings	494.720	0,09	12.574	UroGen Pharma	242.552	0,04
2.216	Quidel	486.146	0,09	4.051	Valero Energy	175.489	0,03
6.745	Radius Health	76.488	0,01	8.107	Vaxcyte	400.324	0,07
10.304	Rapid7	631.017	0,11	25.334	VICI Properties	592.056	0,11
2.714	Reata Pharmaceuticals	264.398	0,05	10.613	Voya Financial	508.681	0,09
7	Regeneron Pharmaceuticals	3.918	-	1.437	Vulcan Materials	194.771	0,04
38.345	Regions Financial	442.118	0,08	32.977	Western Alliance Bancorporation	1.042.733	0,19
1.500	Relay Therapeutics	63.885	0,01	77.140	Whiting Petroleum	1.333.751	0,24
16.703	Repay Holdings	392.521	0,07	67.710	Williams	1.330.502	0,24
2.156	Repligen	318.096	0,06	11.046	Wintrust Financial	442.392	0,08
1.023	Revolution Medicines	35.600	0,01	22.782	Wolverine World Wide	588.687	0,11
18.255	Rhythm Pharmaceuticals	395.586	0,07	2.370	Workday	509.858	0,09
52.414	Ribbit LEAP	681.382	0,12	93.938	WPX Energy	460.296	0,08
8.673	Royalty Pharma	364.873	0,07	1.258	Zions Bancorporation	36.759	0,01
6.361	Sabre	591.446	0,11		Summe Aktien	182.099.665	32,99
7.650	Santa Cruz County Bank	278.460	0,05		Anleihen		
4.181	Sarepta Therapeutics	587.138	0,11		Argentinien	3.120.549	0,57
9.432	Science Applications International	739.657	0,13	85.000	Argentina Bonar Bonds 07/05/24, 8.75%	31.080	0,01
2.297	Select Bancorporation	16.515	-	241.475	Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00%	110.716	0,02
3.062	Signature Bank	254.115	0,05	1.338.761	Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.13%	565.626	0,10
16.281	Skyline Champion	435.842	0,08	4.139.510	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 0.13%	1.566.804	0,29
60.115	SLM	486.330	0,09	68.000	Autonomous City of Buenos Aires of Argentina 19/02/21, 8.95%	61.880	0,01
18.529	Solar Capital	293.685	0,05	52.922	Compania Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 20/07/23, 9.50%	20.640	-
1.225	South Atlantic Bancshares	10.266	0,00				
4.080	South State	196.452	0,04				
3.700	StepStone Group	98.457	0,02				
439	STERIS	77.347	0,01				
9.343	Stewart Information Services	408.569	0,07				
10.554	Sunnova Energy International	320.947	0,06				
34.551	Syndax Pharmaceuticals	509.973	0,09				
11.883	Tandem Diabetes Care	1.348.721	0,24				

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
300.000	Provincia de Cordoba 01/09/24, 7.45%	180.000	0,03
540.000	Provincia de Cordoba 01/08/27, 7.13%	299.700	0,05
45.000	YPF 23/03/25, 8.50%	35.708	0,01
350.000	YPF 27/06/29, 8.50%	248.395	0,05
Australien		4.864.550	0,88
4.265.000	Australia Government Bond 21/06/51, 1.75%	3.071.400	0,56
2.490.000	Australia Government Bond 21/06/51, 1.75%	1.793.150	0,32
Österreich		1.205.697	0,22
1.200.000	Oesterreichische Kontrollbank 22/11/21, variabel	1.205.697	0,22
Aserbaidzhan		972.127	0,18
645.000	Southern Gas Corridor 24/03/26, 6.88%	735.187	0,14
200.000	State Oil of the Azerbaijan Republic 18/03/30, 6.95%	236.940	0,04
Bermuda		202.750	0,04
200.000	Bermuda Government International Bond 20/08/30, 2.38%	202.750	0,04
Brasilien		618.461	0,11
200.000	Brazilian Government International Bond 06/06/25, 2.88%	201.952	0,04
205.000	Brazilian Government International Bond 12/06/30, 3.88%	205.359	0,04
205.000	Vale Overseas 08/07/30, 3.75%	211.150	0,03
Kanada		755.216	0,14
700.000	Province of Quebec Canada 01/12/20, 4.50%	529.478	0,10
300.000	PSP Capital 22/10/20, 3.03%	225.738	0,04
Chile		222.459	0,04
200.000	Engie Energia Chile 29/01/25, 4.50%	222.459	0,04
China		3.959.289	0,72
300.000	Bank of China 08/03/21, variabel	300.095	0,05
200.000	Bank of China 20/11/21, variabel	200.204	0,04
500.000	Bank of China 16/01/22, variabel	498.993	0,09
450.000	China Construction Bank 04/12/20, variabel	450.162	0,08
750.000	China Construction Bank 24/09/21, variabel	750.385	0,13

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
450.000	ICBCIL Finance 15/05/21, variabel	448.965	0,08
255.000	Industrial & Commercial Bank of China 12/10/20, variabel	255.018	0,05
650.000	Industrial & Commercial Bank of China 16/04/21, variabel	650.324	0,12
200.000	Industrial & Commercial Bank of China 14/06/21, variabel	200.040	0,04
200.000	Prosus 03/08/50, 4.03%	205.103	0,04
Kolumbien		5.230.163	0,94
330.000	Bancolombia 18/12/29, variabel	321.338	0,06
210.000	Colombia Government International Bond 15/04/31, 3.13%	215.830	0,04
200.000	Colombia Government International Bond 15/05/51, 4.13%	208.900	0,04
3.616.000.000	Colombian TES 30/06/32, 7.00%	1.024.427	0,19
4.026.400.000	Colombian TES 18/10/34, 7.25%	1.152.391	0,20
7.005.300.000	Colombian TES 26/10/50, 7.25%	1.917.683	0,34
325.000	Ecopetrol 29/04/30, 6.88%	389.594	0,07
Kroatien		781.066	0,14
640.000	Croatia Government International Bond 17/06/31, 1.50%	781.066	0,14
Dominikanische Republik		1.023.576	0,19
150.000	Dominican Republic International Bond 19/07/28, 6.00%	161.786	0,03
480.000	Dominican Republic International Bond 23/09/32, 4.88%	478.560	0,09
380.000	Dominican Republic International Bond 05/06/49, 6.40%	383.230	0,07
Ecuador		573.330	0,10
71.590	Ecuador Government International Bond 31/07/30, ZCP	33.561	0,01
196.560	Ecuador Government International Bond 31/07/30, 0.50%	133.663	0,02
515.112	Ecuador Government International Bond 31/07/35, 0.50%	287.181	0,05
236.080	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 0.50%	118.925	0,02

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Ägypten		596.132	0,11
205.000	Egypt Government International Bond 29/05/24, 5.75%	210.104	0,04
140.000	Egypt Government International Bond 11/04/25, 4.75%	160.526	0,03
230.000	Egypt Government International Bond 29/05/32, 7.63%	225.502	0,04
El Salvador		208.815	0,04
105.000	El Salvador Government International Bond 18/01/27, 6.38%	90.930	0,02
150.000	El Salvador Government International Bond 20/01/50, 7.12%	117.885	0,02
Äthiopien		261.373	0,05
260.000	Ethiopia International Bond 11/12/24, 6.63%	261.373	0,05
Finnland		2.528.720	0,46
1.780.000	Finnair 03/09/69, variabel	2.128.700	0,39
400.000	Kuntarahoitus 26/10/20, variabel	400.020	0,07
Frankreich		1.787.596	0,32
400.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 17/12/21, variabel	402.393	0,07
400.000	Dexia Credit Local 16/10/20, variabel	400.130	0,07
800.000	Unibail-Rodamco-Westfield 29/06/32, 2.00%	985.073	0,18
Gabun		189.378	0,03
200.000	Gabon Government International Bond 12/12/24, 6.38%	189.378	0,03
Deutschland		1.590.872	0,29
190.000	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 27/09/21, variabel	190.144	0,03
200.000	NRW Bank 08/02/21, variabel	200.030	0,04
100.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 16/10/20, variabel	100.006	0,02
300.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 29/01/21, variabel	300.060	0,05
800.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 27/08/21, variabel	800.632	0,15

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Ghana		300.650	0,05
355.000	Ghana Government International Bond 11/02/35, 7.88%	300.650	0,05
Honduras		161.175	0,03
150.000	Honduras Government International Bond 24/06/30, 5.63%	161.175	0,03
Ungarn		1.228.543	0,22
615.000	Hungary Government International Bond 28/04/32, 1.63%	765.488	0,14
375.000	Hungary Government International Bond 05/06/35, 1.75%	463.055	0,08
Indien		546.502	0,10
200.000	Bharti Airtel International Netherlands 11/03/23, 5.13%	211.469	0,04
325.000	Vedanta Holdings Mauritius II 21/08/23, 13.00%	335.033	0,06
Israel		807.130	0,15
245.000	Bank Leumi Le-Israel 29/01/31, variabel	245.655	0,04
163.000	Leviathan Bond 30/06/25, 6.13%	168.705	0,03
238.000	Leviathan Bond 30/06/27, 6.50%	247.520	0,05
140.000	Leviathan Bond 30/06/30, 6.75%	145.250	0,03
Italien		12.248.641	2,21
500.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 14/10/20, ZCP	586.267	0,11
6.264.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/41, 1.80%	7.697.696	1,39
1.994.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/50, 2.45%	2.719.706	0,49
160.000	Italy Certificati di Credito del Tesoro 27/11/20, variabel	187.720	0,03
900.000	Italy Certificati di Credito del Tesoro 15/12/20, variabel	1.057.252	0,19
Elfenbeinküste		433.117	0,08
100.000	Ivory Coast Government International Bond 17/10/40, 6.88%	105.653	0,02
330.000	Ivory Coast Government International Bond 22/03/48, 6.63%	327.464	0,06

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Jordanien			
415.000	Jordan Government International Bond 07/07/25, 4.95%	414.715	0,08
420.000	Jordan Government International Bond 07/07/30, 5.85%	408.826	0,07
Litauen			
795.000	Lithuania Government International Bond 28/07/50, 0.50%	905.303	0,16
Luxemburg			
590.000	Altice Financing 15/01/25, 2.25%	664.733	0,12
Mazedonien			
585.000	North Macedonia Government International Bond 03/06/26, 3.68%	736.879	0,13
Mexiko			
370.000	Mexico Government International Bond 16/04/30, 3.25%	379.920	0,07
990.000	Mexico Government International Bond 27/04/32, 4.75%	1.119.689	0,20
200.000	Mexico Government International Bond 31/01/50, 4.50%	212.000	0,04
830.000	Mexico Government International Bond 27/04/51, 5.00%	932.505	0,17
40.000	Petroleos Mexicanos 23/01/29, 6.50%	35.998	0,01
170.000	Petroleos Mexicanos 12/02/48, 6.35%	128.138	0,02
200.000	Sigma Finance Netherlands 27/03/28, 4.88%	220.852	0,04
Mongolei			
200.000	Mongolia Government International Bond 05/12/22, 5.13%	204.995	0,04
Marokko			
200.000	OCP 25/04/24, 5.63%	217.608	0,04
Niederlande			
750.000	Aegon 15/10/68, variabel	608.941	0,11
Pakistan			
200.000	Pakistan Government International Bond 05/12/27, 6.88%	199.564	0,04
Panama			
370.000	Panama Government International Bond 23/07/60, 3.87%	424.945	0,08

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Paraguay			
200.000	Paraguay Government International Bond 13/03/48, 5.60%	247.302	0,04
Rumänien			
250.000	Romanian Government International Bond 26/05/30, 3.62%	332.192	0,07
65.000	Romanian Government International Bond 08/02/38, 3.38%	81.309	0,01
274.000	Romanian Government International Bond 14/02/51, 4.00%	283.590	0,05
Russland			
8.590.000	Russian Federal Bond - OFZ 23/05/29, 6.90%	116.488	0,02
172.990.000	Russian Federal Bond - OFZ 10/04/30, 7.65%	2.463.446	0,45
3.175.000	Russian Federal Bond - OFZ 17/09/31, 8.50%	48.162	0,01
19.905.000	Russian Federal Bond - OFZ 23/03/33, 7.70%	286.365	0,05
Senegal			
200.000	Senegal Government International Bond 23/05/33, 6.25%	197.927	0,04
Serbien			
360.000	Serbia International Bond 15/05/27, 3.13%	451.849	0,08
205.000	Serbia International Bond 26/06/29, 1.50%	232.631	0,04
Südkorea			
1.450.000	Export-Import Bank of Korea 17/03/21, variabel	1.454.104	0,26
1.185.000	Export-Import Bank of Korea 01/06/21, variabel	1.187.777	0,22
400.000	Korea Development Bank 12/03/21, variabel	400.308	0,07
250.000	Korea Development Bank 12/04/21, variabel	250.743	0,05
Spanien			
500.000	Ibercaja Banco 23/07/30, variabel	538.639	0,09
200.000	Instituto de Credito Oficial 15/12/21, variabel	199.995	0,04
400.000	Spain Letras del Tesoro 15/01/21, ZCP	469.617	0,09
Supranational			
127.500.000	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.263.963	0,23

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
45.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 27/04/28, ZCP	1.121.759	0,20
16.400.000	International Finance 22/02/38, ZCP	222.694	0,04
Tunesien		226.899	0,04
100.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 31/10/23, 6.75%	111.349	0,02
109.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 15/07/26, 6.38%	115.550	0,02
Türkei		198.772	0,04
250.000	Turkey Government International Bond 11/05/47, 5.75%	198.772	0,04
Ukraine		896.871	0,16
370.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance 19/07/22, 7.38%	373.170	0,06
100.000	Ukraine Government International Bond 01/09/24, 7.75%	100.625	0,02
100.000	Ukraine Government International Bond 01/09/26, 7.75%	99.746	0,02
350.000	Ukraine Government International Bond 15/03/33, 7.25%	323.330	0,06
Vereinigte Arabische Emirate		604.918	0,11
200.000	ADCB Finance Cayman 06/03/23, 4.50%	212.860	0,04
205.000	Dubai DOF Sukuk 09/09/30, 2.76%	204.794	0,04
200.000	Emirate of Dubai Government International Bonds 09/09/50, 3.90%	187.264	0,03
Vereinigtes Königreich		1.887.868	0,34
885.000	Vodafone Group 27/08/80, variabel	1.033.374	0,19
745.000	Vodafone Group 27/08/80, variabel	854.494	0,15
Vereinigte Staaten		6.063.796	1,09
820.000	Carnival 01/02/26, 10.13%	1.024.617	0,19
296.000	Enable Midstream Partners 15/03/27, 4.40%	284.072	0,05
554.000	Enable Midstream Partners 15/09/29, 4.15%	514.368	0,09

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
754.000	Magellan Midstream Partners 01/03/50, 3.95%	774.579	0,14
1.065.000	United States Treasury Note 31/10/20, variabel	1.065.034	0,19
1.710.000	United States Treasury Note 31/01/21, variabel	1.710.607	0,30
260.000	United States Treasury Note 30/04/21, variabel	260.216	0,05
415.000	WPX Energy 01/06/26, 5.75%	430.303	0,08
Uruguay		1.670.943	0,30
61.108.025	Uruguay Government International Bond 02/07/40, 3.88%	1.670.943	0,30
Venezuela		28.800	0,01
360.000	Venezuela Government International Bond 07/05/28, 9.25%*	28.800	0,01
Vietnam		256.047	0,05
250.000	Mong Duong Finance Holdings 07/05/29, 5.13%	256.047	0,05
Summe Anleihen		77.919.262	14,12
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		260.018.927	47,11

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Brasilien		1.557.603	0,28
200.000	Centrais Eletricas Brasileiras 04/02/25, 3.63%	199.810	0,04
210.000	Centrais Eletricas Brasileiras 04/02/30, 4.63%	210.893	0,04
335.000	Rede D'or Finance 22/01/30, 4.50%	320.093	0,06
540.000	Rumo Luxembourg 18/01/25, 5.88%	566.381	0,09
250.000	Rumo Luxembourg 10/01/28, 5.25%	260.426	0,05
Kanada		10.710.210	1,94
200.000	Canadian Government Bond Coupon Strip 01/06/21, ZCP	150.064	0,03
1.400.000	Canadian Government Bond Residual Strip 15/03/21, ZCP	1.051.144	0,18

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
250.000	CDP Financial 22/04/21, ZCP	249.295	0,05	700.000	Province of British Columbia Canada Interest Strip 04/06/21, ZCP	524.752	0,10
500.000	CDP Financial 25/05/21, ZCP	498.722	0,09	66.000	Province of Nova Scotia Canada Generic Strip 01/12/20, ZCP	49.568	0,01
100.000	City of Quebec Canada 07/06/21, 4.00%	77.040	0,01	450.000	Province of Ontario Generic Coupon Strip 03/11/20, ZCP	338.043	0,06
95.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 07/10/20, ZCP	71.343	0,01	450.000	Province of Ontario Generic Coupon Strip 02/12/20, ZCP	337.952	0,06
250.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 04/11/20, ZCP	187.711	0,03	500.000	Province of Ontario Generic Coupon Strip 13/01/21, ZCP	375.333	0,07
200.000	New Brunswick Municipal Finance 19/11/20, 3.85%	150.872	0,03	125.000	Province of Quebec Interest Strip 21/03/21, ZCP	93.785	0,02
200.000	New Brunswick Municipal Finance 27/05/21, 4.25%	153.813	0,03	100.000	Province of Saskatchewan Canada Coupon Strip 04/02/21, ZCP	75.047	0,01
100.000	Newfoundland Treasury Bill 08/10/20, ZCP	75.097	0,01	350.000	PSP Capital 27/04/21, ZCP	374.607	0,07
350.000	Ontario Hydro Coupon Strip 26/11/20, ZCP	262.846	0,05	500.000	Quebec Treasury Bill 09/10/20, ZCP	93.867	0,02
1.000.000	Ontario Hydro Coupon Strip 18/02/21, ZCP	750.179	0,13	125.000	Quebec Treasury Bill 13/11/20, ZCP	262.725	0,05
600.000	Ontario Hydro Residual Strip 27/11/20, ZCP	450.661	0,08	350.000	Regional Municipality of Peel Ontario 27/03/21, 2.35%	473.565	0,09
200.000	Ontario Treasury Bill 21/10/20, ZCP	150.169	0,03	625.000	Regional Municipality of York 30/06/21, 4.00%	616.989	0,11
250.000	Ontario Treasury Bill 12/11/20, ZCP	187.678	0,03	200.000	South Coast British Columbia Transportation 02/11/20, 3.80%	150.624	0,03
350.000	Ontario Treasury Bill 18/11/20, ZCP	262.649	0,05	300.000	Ville De Montreal 19/11/20, ZCP	225.229	0,04
500.000	Ontario Treasury Bill 25/11/20, ZCP	375.136	0,07				
300.000	Ontario Treasury Bill 10/02/21, ZCP	224.968	0,04	Chile		207.100	0,04
200.000	Ontario Treasury Bill 31/03/21, ZCP	149.904	0,03	200.000	VTR Comunicaciones 15/01/28, 5.13%	207.100	0,04
500.000	Prince Edward Island Provincial 01/12/20, ZCP	375.371	0,07	China		413.491	0,07
300.000	Province of Alberta Coupon Strip 01/06/21, ZCP	224.837	0,04	400.000	Yingde Gases Investment 19/01/23, 6.25%	413.491	0,07
100.000	Province of British Columbia 16/10/20, ZCP	75.088	0,01	Frankreich		249.375	0,05
500.000	Province of British Columbia 19/04/21, ZCP	374.988	0,07	250.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 15/06/21, ZCP	249.375	0,05
150.000	Province of British Columbia 18/12/20, 3.70%	113.497	0,02	Japan		19.619.448	3,55
100.000	Province of British Columbia Canada Interest Strip 19/02/21, ZCP	75.052	0,01	41.150.000	Japan Treasury Discount Bill 05/10/20, ZCP	390.181	0,07
				55.750.000	Japan Treasury Discount Bill 12/10/20, ZCP	528.626	0,10

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2020 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
122.950.000	Japan Treasury Discount Bill 19/10/20, ZCP	1.165.840	0,21	2.325.000	Avis Budget Car Rental/ Avis Budget Finance 15/07/27, 5.75%	2.097.348	0,38
164.000.000	Japan Treasury Discount Bill 26/10/20, ZCP	1.555.110	0,28	345.000	Broadcom 15/11/25, 3.15%	374.117	0,07
190.800.000	Japan Treasury Discount Bill 02/11/20, ZCP	1.809.268	0,33	1.330.000	Caesars Resort Collection/CRC Finco 01/07/25, 5.75%	1.373.225	0,25
116.050.000	Japan Treasury Discount Bill 09/11/20, ZCP	1.100.452	0,20	412.000	Cardlytics 15/09/25, 1.00%	451.646	0,08
268.550.000	Japan Treasury Discount Bill 16/11/20, ZCP	2.546.568	0,46	1.605.000	Carnival 01/02/26, 10.50%	1.780.547	0,32
216.650.000	Japan Treasury Discount Bill 24/11/20, ZCP	2.054.488	0,37	590.000	Chegg 01/09/26, ZCP	590.885	0,11
80.150.000	Japan Treasury Discount Bill 30/11/20, ZCP	760.080	0,14	2.295.000	Cornerstone Building Brands 15/01/29, 6.13%	2.331.754	0,42
100.000.000	Japan Treasury Discount Bill 07/12/20, ZCP	948.402	0,17	3.710.000	DISH DBS 01/07/28, 7.38%	3.825.937	0,70
506.550.000	Japan Treasury Discount Bill 14/12/20, ZCP	4.804.163	0,87	315.000	Dun & Bradstreet 15/08/26, 6.88%	338.916	0,06
122.000.000	Japan Treasury Discount Bill 21/12/20, ZCP	1.157.066	0,21	265.000	Endeavor Energy Resources/EER Finance 15/07/25, 6.63%	272.701	0,05
29.950.000	Japan Treasury Discount Bill 21/12/20, ZCP	284.081	0,05	216.000	Helix Energy Solutions Group 15/02/26, 6.75%	177.766	0,03
54.300.000	Japan Treasury Discount Bill 12/01/21, ZCP	515.123	0,09	2.210.000	Kraft Heinz Foods 01/03/31, 4.25%	2.430.768	0,45
Mexiko		2.108.392	0,38	1.050.000	L Brands 01/10/30, 6.63%	1.071.000	0,19
185.000	Petroleos Mexicanos 28/01/31, 5.95%	156.464	0,03	620.000	Livent 15/07/25, 4.13%	783.696	0,14
465.000	Petroleos Mexicanos 02/06/41, 6.50%	359.394	0,07	737.000	Matador Resources 15/09/26, 5.88%	617.477	0,11
220.000	Petroleos Mexicanos 23/01/45, 6.38%	168.957	0,03	1.045.000	Middleby 01/09/25, 1.00%	1.031.938	0,19
1.698.000	Petroleos Mexicanos 23/01/50, 7.69%	1.423.577	0,25	2.830.000	NBCUniversal Enterprise 19/06/69, 5.25%	2.861.837	0,53
Panama		250.692	0,05	423.000	Noble Energy 15/11/44, 5.05%	549.743	0,10
240.000	Cable Onda 30/01/30, 4.50%	250.692	0,05	1.092.000	Omniceil 15/09/25, 0.25%	1.124.859	0,20
Peru		572.946	0,10	198.000	Parsley Energy/Parsley Finance 15/02/28, 4.13%	186.595	0,03
355.000	Banco de Credito del Peru 01/07/30, variabel	356.732	0,06	867.000	Splunk 15/06/27, 1.13%	937.172	0,17
200.000	Kallpa Generacion 24/05/26, 4.88%	216.214	0,04	376.000	Targa Resources Partners/Targa Resources Partners Finance 15/11/23, 4.25%	373.219	0,07
Russland		1.622.000	0,29	855.000	Tempo Acquisition/ Tempo Acquisition Finance 01/06/25, 5.75%	898.819	0,16
1.600.000	Mail.Ru Group 01/10/25, 1.63%	1.622.000	0,29	4.293.000	United States Cash Management Bill 01/12/20, ZCP	4.292.144	0,78
Südkorea		898.754	0,16	186.000	United States Cash Management Bill 08/12/20, ZCP	185.966	0,03
500.000	Korea Development Bank 28/05/21, ZCP	499.104	0,09				
400.000	Korea Development Bank 07/11/21, variabel	399.650	0,07				
Vereinigte Staaten		137.338.060	24,90				
385.000	Adams Homes 15/02/25, 7.50%	390.053	0,07				

Die Anmerkungen auf den Seiten 59 bis 128 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020

Die Gesellschaft

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

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

Anteilsklassen

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

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

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

Ausgabeaufschlag

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

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

Vertriebsgebühr

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

Swing-Pricing

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

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

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

Am 30. September 2020, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahres, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für den Schroder GAIA Cat Bond und den Schroder GAIA Contour Tech Equity vorgenommen. Die nachfolgende Tabelle stellt den offiziellen Nettoinventarwert je Anteil dieser Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin dar. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing-Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

	Währung	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity
Nettoinventarwert je Anteil* (einschließlich Swing-Pricing-Anpassung)			
zum 30. September 2020			
Klasse A Thes.	USD	1.423,84	123,29
Klasse A Thes. in CHF abgesichert	CHF	–	115,72
Klasse A Thes. in EUR abgesichert	EUR	–	116,91
Klasse A Thes. in SGD abgesichert	SGD	–	171,36
Klasse A1 Thes.	USD	–	123,24
Klasse C Thes.	USD	1.427,05	126,42
Klasse C Thes. in CHF abgesichert	CHF	1.134,96	119,89
Klasse C Thes. in EUR abgesichert	EUR	1.190,84	119,72
Klasse C Thes. in GBP abgesichert	GBP	101,65	97,92
Klasse C Thes. SEK Hedged	SEK	–	990,88
Klasse C Thes. in SGD abgesichert	SGD	–	174,59
Klasse E Thes.	USD	–	126,88
Klasse E Thes. in CHF abgesichert	CHF	–	119,06
Klasse E Thes. in EUR abgesichert	EUR	–	120,00
Klasse E Thes. in GBP abgesichert	GBP	–	97,50
Klasse E Thes. SEK Hedged	SEK	–	986,94
Klasse E Thes. in SGD abgesichert	SGD	–	175,54
Klasse F Thes.	USD	1.422,19	–
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.133,68	–
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.188,19	–
Klasse F Aussch.	USD	1.173,16	–
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	SGD	1.570,36	–
Klasse I Thes.	USD	1.587,37	139,88
Klasse I Thes. in CHF abgesichert	CHF	1.359,34	–
Klasse I Thes. in EUR abgesichert	EUR	1.429,83	–
Klasse I Thes. JPY Hedged	JPY	10.172,29	–
Klasse IF Thes.	USD	1.462,48	–
Klasse IF Thes. in CHF abgesichert	CHF	1.252,18	–
Klasse IF Thes. in EUR abgesichert	EUR	1.316,94	–
Klasse IF Aussch. QV	USD	1.395,95	–

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

Der Abschluss wird im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt und dargestellt. Abschlüsse für Teilfonds, die während des Jahres liquidiert wurden, werden unter der Annahme der Nichtfortführung der Geschäftstätigkeit erstellt.

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

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

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

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

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

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

Fair Value Pricing

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

Zum 30. September 2020 wurden bei keinem der Teilfonds Anpassungen des Fair Value vorgenommen.

Besteuerung

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

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

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Managementgebühren

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

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schroder GAIA BlueTrend	A ¹ -Anteile	1,60 %
	C ² -, E- und N-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50 %
	C- und IF-Anteile	1,10 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und C1*-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und E-Anteile	1,25 %
	X*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Helix	A-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,00 %
	E-Anteile	0,75 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,60 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*	A-Anteile	1,92 %
	C-Anteile	1,20 %
	E-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*	A-Anteile	1,92 %
	C-Anteile	1,20 %
	E-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Sirius US Equity	A-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	X*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C- und R-Anteile	1,00 %
	K-Anteile	1,50 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	0,75 %
	I-Anteile	Entfällt

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

¹ 2,00 % bis zum 30. Juni 2020, 1,60 % seit dem 01. Juli 2020.

² 1,25 % bis zum 30. Juni 2020, 1,00 % seit dem 01. Juli 2020.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvre-Lorenzini, Bernard Herman und Eric Bertrand erhielten für das Berichtsjahr jeweils eine Vergütung in Höhe von 20.167 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 8.263 EUR. Daniel de Fernando Garcia erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 7.780 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

Performancegebühren

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

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

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

Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
Schroder GAIA BlueTrend	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend CHF Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend EUR Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend GBP Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend SGD Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity CHF Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity EUR Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity GBP Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SEK Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SGD Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Egerton Equity	Egerton Capital (UK) LLP	EONIA + 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity GBP Hedged	Egerton Capital (UK) LLP	SONIA + 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity JPY Hedged	Egerton Capital (UK) LLP	Mutan JYMUON + 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity USD Hedged	Egerton Capital (UK) LLP	US Overnight + 1,00 %
Schroder GAIA Helix	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix CHF Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix EUR Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix GBP Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix JPY Hedged*	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix SGD Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Sirios US Equity	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity CHF Hedged	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR CHF 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity EUR Hedged	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR EUR 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity GBP Hedged	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR GBP 3 Month Act 365
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified CHF Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified EUR Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified GBP Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund CHF Hedged	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund EUR Hedged	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund USD Hedged	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa BRL Hedged*	Wellington Management International Limited	Brazil CETIP DI Interbank Deposit Rate
Schroder GAIA Wellington Pagosa CHF Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa EUR Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa GBP Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa SGD Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360

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

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

Für den Schroder GAIA BlueTrend beträgt die Performancegebühr 10 % der Outperformance (vor dem 01. Juli 2020 betrug die Performancegebühr 20 % der Outperformance, mit Ausnahme von E-Anteile, für die sich die Gebühr auf 15 % der Outperformance belief).

Für den Schroder GAIA Cat Bond, den Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short* und den Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral* wird keine Performancegebühr erhoben.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

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

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 2020 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	11.100.000	USD	8.079.527	21. Okt. 2020	(128.865)
BRL	4.333.648	USD	822.028	27. Okt. 2020	(50.873)
BRL	28.939.572	USD	5.420.843	16. Dez. 2020	(278.820)
CAD	25.242.849	USD	19.187.302	21. Okt. 2020	(228.670)
CLP	1.519.122.387	USD	1.975.620	21. Okt. 2020	(40.235)
EUR	15.500.000	USD	18.346.379	21. Okt. 2020	(166.160)
GBP	6.100.000	USD	8.103.896	21. Okt. 2020	(231.995)
HUF	480.683.190	USD	1.599.080	21. Okt. 2020	(49.036)
IDR	112.993.328.711	USD	7.567.061	16. Dez. 2020	(27.390)
INR	1.336.590.687	USD	17.765.268	16. Dez. 2020	206.905
JPY	1.911.032.188	USD	18.083.941	21. Okt. 2020	39.978
KRW	10.145.783.302	USD	8.605.173	16. Dez. 2020	70.701
MXN	153.897.448	USD	7.033.481	21. Okt. 2020	(89.550)
NOK	26.594.419	USD	2.994.671	21. Okt. 2020	(143.431)
NZD	20.300.000	USD	13.576.908	21. Okt. 2020	(147.404)
PHP	229.498.140	USD	4.691.901	16. Dez. 2020	27.371
PLN	24.645.242	USD	6.605.597	21. Okt. 2020	(229.490)
RUB	210.999.769	USD	2.764.081	16. Dez. 2020	(71.525)
SEK	108.219.868	USD	12.351.675	21. Okt. 2020	(265.610)
SGD	14.294.237	USD	10.458.239	21. Okt. 2020	13.520
THB	212.995.533	USD	6.812.270	21. Okt. 2020	(90.844)
TWD	259.876.352	USD	8.973.762	16. Dez. 2020	1.341
USD	8.386.710	AUD	11.700.000	21. Okt. 2020	6.280
USD	584.564	AUD	830.000	27. Okt. 2020	(9.953)
USD	11.477.257	BRL	63.997.624	16. Dez. 2020	106.069
USD	11.945.213	CAD	15.862.870	21. Okt. 2020	31.410
USD	1.156.338	CAD	1.550.000	27. Okt. 2020	(7.812)
USD	102.471	CHF	95.000	27. Okt. 2020	(746)
USD	2.940.744	CLP	2.305.975.698	21. Okt. 2020	2.896
USD	9.876	CZK	230.000	27. Okt. 2020	(91)
USD	9.769.915	EUR	8.300.000	21. Okt. 2020	34.701
USD	3.105.960	EUR	2.665.000	27. Okt. 2020	(20.268)
USD	8.891.464	GBP	6.900.000	21. Okt. 2020	(12.820)
USD	1.280.957	GBP	1.005.000	27. Okt. 2020	(16.014)
USD	154.797	HKD	1.200.000	27. Okt. 2020	(25)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	3.792.372	HUF	1.170.423.109	21. Okt. 2020	18.151
USD	53.296	HUF	16.665.000	27. Okt. 2020	(438)
USD	4.995.408	IDR	75.202.545.358	16. Dez. 2020	(22.611)
USD	4.309	ILS	15.000	27. Okt. 2020	(71)
USD	7.162.316	INR	532.593.380	16. Dez. 2020	915
USD	9.307.233	JPY	982.447.927	21. Okt. 2020	(10.143)
USD	613.869	JPY	64.695.000	27. Okt. 2020	269
USD	964.054	KRW	1.121.842.836	27. Okt. 2020	4.810
USD	6.007.722	KRW	7.094.359.418	16. Dez. 2020	(58.815)
USD	6.240.255	MXN	137.999.500	21. Okt. 2020	13.648
USD	4.875	MXN	110.000	27. Okt. 2020	(85)
USD	3.416.340	NOK	31.328.733	21. Okt. 2020	57.524
USD	9.174.837	NZD	13.800.000	21. Okt. 2020	45.420
USD	13.052	NZD	20.000	27. Okt. 2020	(179)
USD	416.852	PHP	20.339.234	16. Dez. 2020	(1.392)
USD	5.390.676	PLN	20.647.165	21. Okt. 2020	48.931
USD	7.008.947	RUB	529.699.928	16. Dez. 2020	249.475
USD	7.394.055	SEK	65.660.179	21. Okt. 2020	61.081
USD	47.746	SEK	435.000	27. Okt. 2020	(838)
USD	6.734.754	SGD	9.230.151	21. Okt. 2020	(27.127)
USD	228.739	SGD	315.000	27. Okt. 2020	(2.027)
USD	7.347.983	THB	231.995.516	21. Okt. 2020	26.977
USD	583.378	THB	18.203.444	27. Okt. 2020	8.943
USD	282.954	TRY	2.190.000	27. Okt. 2020	1.183
USD	5.237.118	TWD	150.983.857	16. Dez. 2020	22.731
USD	2.544.863	ZAR	43.175.883	21. Okt. 2020	(26.758)
USD	310.135	ZAR	5.335.000	27. Okt. 2020	(7.394)
ZAR	41.453.308	USD	2.481.650	21. Okt. 2020	(12.631)
					USD (1.376.906)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	573.855	USD	624.548	30. Okt. 2020	(1.006)
EUR	8.134.628	USD	9.528.770	30. Okt. 2020	14.323
GBP	38.741.074	USD	49.237.040	30. Okt. 2020	759.893
SGD	12.140	USD	8.893	30. Okt. 2020	-
USD	281.609	CHF	259.801	30. Okt. 2020	(687)
USD	483.914	EUR	414.853	30. Okt. 2020	(2.769)
USD	1.227.313	GBP	963.975	30. Okt. 2020	(16.738)
USD	170	SGD	234	30. Okt. 2020	(1)
					USD 753.015
					USD (623.891)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	49.618.597	EUR	42.450.000	30. Okt. 2020	(181.382)
					USD (181.382)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	177.446.499	USD	193.133.185	30. Okt. 2020	(322.156)
EUR	605.327.548	USD	709.083.197	30. Okt. 2020	1.053.412
GBP	10.105	USD	12.842	30. Okt. 2020	200
JPY	1.213.283	USD	11.554	30. Okt. 2020	(46)
SGD	495.872	USD	363.290	30. Okt. 2020	(18)
USD	31.373	CHF	29.108	30. Okt. 2020	(254)
USD	403.413	EUR	346.791	30. Okt. 2020	(3.423)
					USD 727.715
					USD 546.333
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	1.526.373	USD	1.093.525	13. Nov. 2020	(156)
CNH	19.657.534	USD	2.846.202	13. Nov. 2020	42.586
EUR	4.556.678	USD	5.403.514	13. Nov. 2020	(56.309)
GBP	1.887.635	USD	2.465.183	13. Nov. 2020	(28.952)
HKD	26.455.461	USD	3.413.520	13. Nov. 2020	(489)
JPY	426.058.913	USD	4.023.048	13. Nov. 2020	18.679
NOK	589.186	USD	62.554	13. Nov. 2020	616
USD	890.219	AUD	1.238.564	13. Nov. 2020	3.013
USD	2.736.325	CNH	18.857.012	13. Nov. 2020	(34.821)
USD	8.859.832	EUR	7.520.612	13. Nov. 2020	34.491
USD	2.760.557	GBP	2.119.816	13. Nov. 2020	24.668
USD	3.287.392	HKD	25.495.574	13. Nov. 2020	(1.804)
USD	4.033.917	JPY	427.381.898	13. Nov. 2020	(20.360)
USD	10.666	NOK	97.900	13. Nov. 2020	168
					USD (18.670)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	742.278	USD	807.915	30. Okt. 2020	(1.366)
EUR	63.897.977	USD	74.820.627	30. Okt. 2020	140.926
GBP	22.563.166	USD	28.673.332	30. Okt. 2020	445.355
SEK	129.496.781	USD	14.522.833	30. Okt. 2020	(59.146)
SGD	52.559	USD	38.507	30. Okt. 2020	(2)
USD	9.800	CHF	9.066	30. Okt. 2020	(52)
USD	946.261	EUR	812.356	30. Okt. 2020	(6.749)
USD	403.597	GBP	316.814	30. Okt. 2020	(5.265)
USD	175.555	SEK	1.595.552	30. Okt. 2020	(2.655)
USD	441	SGD	607	30. Okt. 2020	(4)
					USD 511.042
					USD 492.372

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CNY	87.177.000	EUR	10.932.245	14. Okt. 2020	(27.504)
EUR	6.667.729	AUD	10.876.000	14. Okt. 2020	25.102
EUR	4.167.648	BRL	26.538.000	15. Okt. 2020	139.851
EUR	21.211.654	CAD	33.003.000	14. Okt. 2020	76.302
EUR	118.952.736	CNY	963.422.000	14. Okt. 2020	(1.559.177)
EUR	28.879.477	GBP	26.116.000	14. Okt. 2020	142.745
EUR	10.539.105	HKD	96.415.000	14. Okt. 2020	(68.775)
EUR	47.597.956	JPY	5.951.220.000	14. Okt. 2020	(525.055)
EUR	12.787.391	RUB	1.155.195.000	13. Okt. 2020	124.980
EUR	9.365.911	SEK	97.318.000	14. Okt. 2020	98.970
EUR	745.163.515	USD	879.430.000	14. Okt. 2020	(4.729.258)
EUR	2.175.800	ZAR	43.672.000	14. Okt. 2020	(44.116)
JPY	762.240.000	EUR	6.161.955	14. Okt. 2020	1.703
KRW	11.528.408.000	EUR	8.205.681	14. Okt. 2020	199.716
USD	46.944.000	EUR	39.759.128	14. Okt. 2020	270.170
					EUR (5.874.346)
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	1.019.424	GBP	932.907	30. Okt. 2020	(6.839)
EUR	254.907	JPY	31.293.244	30. Okt. 2020	1.903
EUR	4.767.735	USD	5.557.253	30. Okt. 2020	30.678
GBP	64.217.065	EUR	69.692.181	30. Okt. 2020	951.091
JPY	3.053.766.060	EUR	24.831.145	30. Okt. 2020	(141.568)
USD	387.856.765	EUR	331.217.840	30. Okt. 2020	(605.031)
					EUR 230.234
					EUR (5.644.112)
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	75.000	USD	54.717	15. Okt. 2020	(997)
AUD	3.997.000	USD	2.868.711	18. Nov. 2020	(5.545)
AUD	7.061.000	USD	5.081.173	19. Nov. 2020	(23.162)
CAD	3.504.000	USD	2.668.629	19. Nov. 2020	(36.727)
CHF	10.137.000	EUR	9.426.360	19. Nov. 2020	(42.227)
CHF	7.181.000	USD	7.907.097	19. Nov. 2020	(99.974)
CLP	92.600.000	USD	119.298	6. Nov. 2020	(1.308)
DKK	23.448.000	USD	3.731.223	19. Nov. 2020	(35.434)
EUR	380.651	CHF	410.000	19. Nov. 2020	996
EUR	862.093	DKK	6.417.000	19. Nov. 2020	357
EUR	48.315	NOK	517.000	19. Nov. 2020	1.273
EUR	2.153.016	SEK	22.320.000	19. Nov. 2020	33.373
EUR	18.886.441	USD	22.394.252	19. Nov. 2020	(228.500)
GBP	2.304.000	EUR	2.553.393	19. Nov. 2020	(23.063)
GBP	10.998.282	USD	14.439.902	19. Nov. 2020	(244.853)
HKD	669.626.000	USD	86.378.561	19. Nov. 2020	8.740
JPY	819.278.794	USD	7.776.856	19. Nov. 2020	(4.405)
NOK	30.323.000	EUR	2.847.435	19. Nov. 2020	(90.709)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
NOK	19.289.000	USD	2.151.347	19. Nov. 2020	(83.242)
NZD	608.000	USD	400.060	18. Nov. 2020	2.151
NZD	217.000	USD	142.235	19. Nov. 2020	1.317
SEK	176.808.000	EUR	17.037.462	19. Nov. 2020	(243.628)
SEK	32.978.000	USD	3.743.943	19. Nov. 2020	(59.806)
SGD	1.389.000	USD	1.013.263	18. Nov. 2020	4.335
SGD	5.912.000	USD	4.322.163	19. Nov. 2020	9.046
USD	2.950.475	AUD	4.061.000	19. Nov. 2020	41.457
USD	49.795	BRL	275.000	2. Dez. 2020	915
USD	412.139	CHF	373.000	19. Nov. 2020	6.617
USD	611.817	DKK	3.827.000	19. Nov. 2020	8.620
USD	11.962.769	EUR	10.093.805	19. Nov. 2020	116.345
USD	14.441.650	GBP	10.985.669	19. Nov. 2020	262.878
USD	15.665.982	HKD	121.472.000	19. Nov. 2020	(4.912)
USD	4.488.507	JPY	474.497.685	19. Nov. 2020	(13.024)
USD	50.152	KRW	58.375.000	15. Dez. 2020	234
USD	535.240	NOK	4.776.000	19. Nov. 2020	23.172
USD	145.433	NZD	217.000	19. Nov. 2020	1.881
USD	6.755.073	SEK	59.188.514	19. Nov. 2020	142.830
USD	2.272.063	SGD	3.099.000	19. Nov. 2020	1.695
					USD (573.284)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	83.362	USD	90.731	30. Okt. 2020	(153)
EUR	105.850.288	USD	123.992.338	30. Okt. 2020	185.337
GBP	6.761.976	USD	8.592.843	30. Okt. 2020	133.763
JPY	1.181.658	USD	11.253	30. Okt. 2020	(45)
SGD	44.942	USD	32.925	30. Okt. 2020	(2)
USD	66.311	EUR	56.632	30. Okt. 2020	(126)
USD	7.429	GBP	5.831	30. Okt. 2020	(96)
USD	24	JPY	2.489	30. Okt. 2020	-
					USD 318.678
					USD (254.606)
Schroder GAIA Sirius US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CHF	808.000	USD	891.963	16. Dez. 2020	(12.639)
EUR	3.561.000	USD	4.185.488	16. Dez. 2020	(3.058)
GBP	455.000	USD	578.729	16. Dez. 2020	8.675
USD	41.581.888	EUR	35.001.000	16. Dez. 2020	472.869
USD	7.142.593	GBP	5.549.000	16. Dez. 2020	(21.151)
USD	5.243.486	SEK	45.937.000	16. Dez. 2020	109.155
					USD 553.851
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	4.090.849	USD	4.452.345	30. Okt. 2020	(7.281)
EUR	131.721.883	USD	154.296.405	30. Okt. 2020	232.382
GBP	10.169.768	USD	12.925.543	30. Okt. 2020	198.955
USD	89.823	CHF	83.016	30. Okt. 2020	(380)
USD	15.390.237	EUR	13.171.825	30. Okt. 2020	(62.217)
USD	174.372	GBP	137.289	30. Okt. 2020	(2.805)
					USD 358.654
					USD 912.505

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	10.628.190	USD	7.613.788	16. Dez. 2020	221
BRL	2.217.906	USD	416.299	13. Okt. 2020	(21.501)
BRL	2.217.906	USD	392.546	3. Nov. 2020	2.049
CAD	23.927.121	USD	18.065.977	16. Dez. 2020	(90.325)
CHF	12.681.107	USD	13.872.036	16. Dez. 2020	(71.543)
CNH	42.016.830	USD	6.107.192	16. Dez. 2020	53.499
CZK	5.772.750	USD	257.478	16. Dez. 2020	(7.139)
EUR	143.000.000	USD	169.243.736	16. Dez. 2020	(1.288.826)
GBP	15.584.314	USD	19.916.077	16. Dez. 2020	203.230
ILS	6.982.324	USD	2.069.975	16. Dez. 2020	(29.359)
INR	371.869.571	USD	5.045.036	22. Okt. 2020	(15.279)
JPY	401.077.574	USD	3.819.896	17. Nov. 2020	(14.980)
JPY	13.469.790.385	USD	127.267.724	16. Dez. 2020	587.195
KRW	3.168.972.019	USD	2.714.000	16. Dez. 2020	(4.145)
MXN	63.273.834	USD	2.878.908	16. Dez. 2020	(42.311)
NOK	253.580	USD	28.244	16. Dez. 2020	(1.052)
NZD	1.000.000	USD	678.421	17. Nov. 2020	(16.890)
NZD	2.316.770	USD	1.538.019	16. Dez. 2020	(5.465)
PLN	50.131.840	USD	13.297.865	16. Dez. 2020	(325.626)
RUB	11.273.749	USD	148.852	8. Okt. 2020	(3.854)
SEK	27.244.890	USD	3.082.803	16. Dez. 2020	(37.670)
SGD	12.496.159	USD	9.138.215	16. Dez. 2020	17.064
TWD	20.963.045	USD	727.000	16. Dez. 2020	(3.019)
USD	58.303.384	AUD	80.166.334	16. Dez. 2020	872.418
USD	392.690	BRL	2.217.906	13. Okt. 2020	(2.108)
USD	66.824.243	CAD	87.774.695	16. Dez. 2020	882.027
USD	41.725.850	CHF	38.119.902	16. Dez. 2020	241.030
USD	526.290	CZK	11.817.091	16. Dez. 2020	13.834
USD	20.025.649	EUR	17.000.000	16. Dez. 2020	58.983
USD	94.474.189	GBP	72.089.099	16. Dez. 2020	1.407.363
USD	6.639.512	HUF	2.026.649.747	16. Dez. 2020	110.637
USD	564.781	ILS	1.908.000	16. Dez. 2020	7.159
USD	3.828.822	JPY	401.077.574	17. Nov. 2020	23.907
USD	31.244.894	JPY	3.279.899.157	16. Dez. 2020	112.172
USD	8.865.934	KRW	10.464.515.036	16. Dez. 2020	(82.494)
USD	3.161.210	MXN	69.442.188	16. Dez. 2020	48.083
USD	6.335.266	NOK	57.154.672	16. Dez. 2020	206.430
USD	668.355	NZD	1.000.000	17. Nov. 2020	6.824
USD	15.277.341	NZD	22.882.089	16. Dez. 2020	140.732
USD	3.520.422	PLN	13.438.550	16. Dez. 2020	43.030
USD	9.227.590	SEK	80.998.062	16. Dez. 2020	174.520
USD	4.795.948	SGD	6.563.132	16. Dez. 2020	(12.513)
USD	118.491	TWD	3.409.000	22. Okt. 2020	783
USD	1.058.722	TWD	30.771.764	16. Dez. 2020	(4.013)
USD	4.281.369	ZAR	72.573.462	17. Dez. 2020	(11.443)
ZAR	76.232.085	USD	4.475.974	17. Dez. 2020	33.250
USD					3.154.885

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	11.192.797	USD	12.182.424	30. Okt. 2020	(20.478)
EUR	375.880.546	USD	440.305.203	30. Okt. 2020	656.945
GBP	213.465.744	USD	271.264.748	30. Okt. 2020	4.221.488
USD	8.315	CHF	7.656	30. Okt. 2020	(3)
USD	10.121.285	EUR	8.672.742	30. Okt. 2020	(53.094)
					USD 4.804.858
					USD 7.959.743
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	148.775	GBP	127.472	30. Okt. 2020	(2.209)
EUR	27.696.003	GBP	25.526.016	30. Okt. 2020	(349.434)
USD	4.557.756	GBP	3.587.952	30. Okt. 2020	(56.288)
					GBP (407.931)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
ARS	67.840.000	USD	857.169	7. Okt. 2020	23.517
ARS	34.853.000	USD	430.068	27. Okt. 2020	3.190
AUD	22.334.000	USD	16.211.958	2. Okt. 2020	(215.237)
AUD	9.833.000	USD	6.959.169	4. Nov. 2020	84.219
BRL	82.605.000	USD	15.010.369	2. Okt. 2020	(301.240)
BRL	8.740.000	USD	1.630.749	16. Okt. 2020	(75.100)
BRL	29.988.000	USD	5.470.643	4. Nov. 2020	(135.549)
BRL	26.163.000	USD	4.847.834	2. Dez. 2020	(197.420)
BRL	8.425.000	USD	1.484.974	4. Jan. 2021	11.179
BRL	5.517.000	USD	1.022.614	11. Jan. 2021	(43.125)
BRL	8.140.000	USD	1.536.574	8. Feb. 2021	(92.847)
CAD	500.000	USD	381.356	1. Okt. 2020	(5.853)
CAD	14.134.000	USD	10.697.808	2. Okt. 2020	(83.109)
CAD	300.000	USD	229.624	8. Okt. 2020	(4.319)
CAD	300.000	USD	223.921	21. Okt. 2020	1.395
CAD	432.000	USD	322.892	4. Nov. 2020	1.577
CAD	500.000	USD	367.927	25. Nov. 2020	7.635
CAD	770.000	USD	586.723	16. Dez. 2020	(8.247)
CHF	3.303.000	USD	3.615.249	2. Okt. 2020	(29.124)
CHF	1.673.000	USD	1.804.193	4. Nov. 2020	13.922
CHF	908.000	USD	991.791	16. Dez. 2020	(3.640)
CLP	4.360.672.000	USD	5.569.113	2. Okt. 2020	(14.577)
CLP	1.344.049.000	USD	1.668.883	7. Okt. 2020	43.265
CLP	473.295.000	USD	628.671	3. Nov. 2020	(25.625)
CLP	2.363.035.000	USD	3.070.871	4. Dez. 2020	(58.887)
CLP	557.811.000	USD	716.060	9. Dez. 2020	(5.022)
CLP	1.629.400.000	USD	2.125.796	16. Dez. 2020	(48.652)
CLP	753.546.000	USD	966.704	1. März. 2021	(5.726)
CNH	133.091.000	USD	19.432.180	4. Nov. 2020	138.645
CNH	1.534.000	USD	216.955	27. Nov. 2020	8.255
CNH	40.741.000	USD	5.925.157	16. Dez. 2020	48.467
CNH	2.885.000	USD	410.501	10. Feb. 2021	10.970
CNH	3.446.000	USD	488.102	18. Feb. 2021	15.065

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
COP	21.554.570.000	USD	5.800.836	2. Okt. 2020	(168.599)
COP	4.435.270.000	USD	1.144.099	4. Nov. 2020	12.848
COP	6.381.200.000	USD	1.707.226	16. Dez. 2020	(46.499)
CZK	37.820.000	USD	1.656.491	2. Okt. 2020	(17.804)
CZK	13.520.000	USD	584.369	4. Nov. 2020	1.516
CZK	56.831.000	USD	2.522.741	16. Dez. 2020	(58.225)
DKK	8.450.000	USD	1.326.474	16. Dez. 2020	6.358
EUR	109.728.000	USD	130.095.400	2. Okt. 2020	(1.444.831)
EUR	300.000	USD	349.451	9. Okt. 2020	2.334
EUR	200.000	USD	236.377	14. Okt. 2020	(1.828)
EUR	587.000	USD	685.552	30. Okt. 2020	3.084
EUR	28.760.000	USD	33.505.596	4. Nov. 2020	237.599
EUR	300.000	USD	350.417	4. Dez. 2020	1.796
EUR	3.901.000	USD	4.614.575	16. Dez. 2020	(32.811)
GBP	68.814.000	USD	88.955.015	2. Okt. 2020	(160.926)
GBP	290.000	USD	372.518	30. Okt. 2020	1.739
GBP	2.372.000	USD	3.017.195	4. Nov. 2020	44.042
GBP	3.477.000	USD	4.569.359	16. Dez. 2020	(80.561)
HKD	6.485.000	USD	836.310	16. Dez. 2020	213
HUF	1.470.707.000	USD	4.859.289	2. Okt. 2020	(115.275)
HUF	1.261.407.000	USD	4.038.732	4. Nov. 2020	27.901
HUF	745.632.000	USD	2.437.782	16. Dez. 2020	(35.720)
IDR	29.945.000.000	USD	2.054.158	2. Okt. 2020	(41.725)
IDR	47.433.000.000	USD	3.174.899	16. Dez. 2020	(9.851)
ILS	9.418.000	USD	2.771.285	2. Okt. 2020	(22.066)
ILS	2.713.000	USD	792.278	16. Dez. 2020	609
INR	52.409.000	USD	660.063	8. Okt. 2020	49.825
INR	870.732.000	USD	11.734.933	4. Nov. 2020	26.233
INR	303.941.000	USD	4.092.505	16. Dez. 2020	(5.629)
JPY	10.016.265.000	USD	95.060.131	2. Okt. 2020	(87.725)
JPY	6.923.271.000	USD	65.746.016	4. Nov. 2020	(76.276)
JPY	339.999.000	USD	3.206.601	16. Dez. 2020	20.660
KRW	36.269.100	USD	31.064	8. Okt. 2020	(52)
KRW	6.467.450.000	USD	5.466.091	16. Dez. 2020	64.363
MXN	415.397.000	USD	18.810.218	2. Okt. 2020	(23.749)
MXN	97.840.000	USD	4.362.518	4. Nov. 2020	44.600
MXN	15.160.000	USD	681.348	27. Nov. 2020	(232)
MXN	70.059.000	USD	3.178.718	16. Dez. 2020	(37.939)
MXN	17.090.000	USD	751.209	25. Jan. 2021	11.328
MXN	306.140.000	USD	11.591.821	16. März. 2021	1.986.565
NOK	200.061.000	USD	21.747.930	2. Okt. 2020	(299.419)
NOK	76.948.000	USD	8.055.155	4. Nov. 2020	194.777
NZD	16.125.000	USD	10.726.248	2. Okt. 2020	(58.758)
NZD	2.397.000	USD	1.569.994	4. Nov. 2020	15.723
NZD	545.000	USD	365.978	16. Dez. 2020	(5.458)
PEN	2.755.000	USD	781.339	2. Okt. 2020	(16.825)
PEN	1.315.000	USD	366.459	4. Nov. 2020	(1.552)
PEN	11.805.000	USD	3.325.872	16. Dez. 2020	(50.799)
PHP	295.230.000	USD	6.078.318	2. Okt. 2020	11.409

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
PHP	287.150.000	USD	5.914.277	4. Nov. 2020	2.577
PHP	142.740.000	USD	2.924.220	16. Dez. 2020	11.005
PLN	19.795.000	USD	5.227.330	2. Okt. 2020	(106.257)
PLN	3.910.000	USD	1.014.020	4. Nov. 2020	(2.410)
PLN	225.000	USD	59.888	16. Dez. 2020	(1.666)
RUB	147.033.000	USD	1.851.845	1. Okt. 2020	40.350
RUB	934.553.000	USD	12.133.245	2. Okt. 2020	(106.310)
RUB	83.329.000	USD	1.136.798	29. Okt. 2020	(67.599)
RUB	83.342.000	USD	1.103.429	27. Nov. 2020	(37.243)
RUB	179.684.000	USD	2.369.564	30. Nov. 2020	(71.581)
RUB	340.509.000	USD	4.423.305	16. Dez. 2020	(78.089)
RUB	114.140.000	USD	1.520.751	11. Feb. 2021	(72.938)
SEK	116.597.000	USD	13.047.763	2. Okt. 2020	(28.673)
SEK	47.724.000	USD	5.231.466	4. Nov. 2020	99.181
SGD	11.709.000	USD	8.607.004	2. Okt. 2020	(29.297)
SGD	5.278.000	USD	3.834.103	4. Nov. 2020	32.549
SGD	6.620.000	USD	4.843.529	16. Dez. 2020	6.597
THB	456.571.000	USD	14.560.457	2. Okt. 2020	(151.905)
THB	70.120.000	USD	2.212.928	4. Nov. 2020	(217)
THB	84.830.000	USD	2.697.255	16. Dez. 2020	(20.417)
TRY	155.100.000	USD	20.352.180	2. Okt. 2020	(268.660)
TRY	68.685.000	USD	8.788.398	4. Nov. 2020	27.246
TRY	5.509.000	USD	707.607	10. Dez. 2020	(8.630)
TRY	22.965.000	USD	2.926.101	16. Dez. 2020	(19.303)
TRY	5.322.000	USD	715.323	19. Jan. 2021	(50.778)
TWD	276.162.000	USD	9.515.424	4. Nov. 2020	20.310
TWD	13.820.000	USD	480.711	16. Dez. 2020	(3.423)
USD	813.429	ARS	67.840.000	7. Okt. 2020	(67.257)
USD	875.472	ARS	74.634.000	27. Okt. 2020	(52.302)
USD	782.199	ARS	74.636.000	22. Jan. 2021	(88)
USD	16.168.948	AUD	22.334.000	2. Okt. 2020	172.226
USD	652.916	AUD	925.000	30. Okt. 2020	(9.654)
USD	10.868.038	AUD	15.438.000	4. Nov. 2020	(190.219)
USD	2.469.938	AUD	3.415.000	16. Dez. 2020	23.440
USD	14.879.811	BRL	82.605.000	2. Okt. 2020	170.683
USD	504.399	BRL	2.855.000	16. Okt. 2020	(3.768)
USD	6.724.269	BRL	38.095.000	4. Nov. 2020	(53.122)
USD	5.767.535	BRL	32.014.000	2. Dez. 2020	77.117
USD	360.360	BRL	1.920.000	11. Jan. 2021	19.483
USD	360.196	CAD	500.000	1. Okt. 2020	(15.307)
USD	10.715.814	CAD	14.134.000	2. Okt. 2020	101.118
USD	72.731	CAD	95.000	7. Okt. 2020	1.385
USD	296.113	CAD	400.000	8. Okt. 2020	(4.293)
USD	88.107	CAD	125.000	9. Okt. 2020	(5.770)
USD	71.064	CAD	100.000	16. Okt. 2020	(4.040)
USD	358.402	CAD	500.000	21. Okt. 2020	(17.124)
USD	215.836	CAD	300.000	22. Okt. 2020	(9.480)
USD	2.359.602	CAD	3.145.000	30. Okt. 2020	(2.522)
USD	153.030	CAD	200.000	2. Nov. 2020	2.814

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	332.245	CAD	450.000	3. Nov. 2020	(5.742)
USD	6.802.850	CAD	9.106.000	4. Nov. 2020	(36.516)
USD	179.277	CAD	250.000	12. Nov. 2020	(8.498)
USD	250.550	CAD	350.000	13. Nov. 2020	(12.336)
USD	250.689	CAD	350.000	18. Nov. 2020	(12.200)
USD	378.946	CAD	500.000	19. Nov. 2020	3.389
USD	719.653	CAD	1.000.000	25. Nov. 2020	(31.472)
USD	683.023	CAD	950.000	27. Nov. 2020	(30.550)
USD	957.486	CAD	1.266.000	1. Dez. 2020	6.547
USD	332.243	CAD	450.000	2. Dez. 2020	(5.773)
USD	5.767.338	CAD	7.560.000	16. Dez. 2020	87.760
USD	110.448	CAD	150.000	18. Dez. 2020	(2.245)
USD	363.363	CAD	500.000	13. Jan. 2021	(12.339)
USD	72.671	CAD	100.000	4. Feb. 2021	(2.471)
USD	212.969	CAD	300.000	10. Feb. 2021	(12.458)
USD	735.978	CAD	1.000.000	18. Feb. 2021	(15.450)
USD	72.669	CAD	100.000	19. Feb. 2021	(2.473)
USD	1.009.248	CAD	1.400.000	15. März. 2021	(42.772)
USD	90.830	CAD	125.000	22. März. 2021	(3.101)
USD	460.702	CAD	625.000	29. März. 2021	(8.955)
USD	144.068	CAD	200.000	31. März. 2021	(6.223)
USD	357.568	CAD	500.000	19. Apr. 2021	(18.161)
USD	373.582	CAD	500.000	27. Apr. 2021	(2.148)
USD	151.688	CAD	200.000	27. Mai 2021	1.394
USD	371.343	CAD	500.000	1. Jun. 2021	(4.390)
USD	520.839	CAD	700.000	4. Jun. 2021	(5.190)
USD	74.329	CAD	100.000	7. Jun. 2021	(818)
USD	586.848	CAD	800.000	30. Jun. 2021	(14.333)
USD	3.606.769	CHF	3.303.000	2. Okt. 2020	20.645
USD	937.518	CHF	867.000	30. Okt. 2020	(4.553)
USD	776.131	CHF	719.000	4. Nov. 2020	(5.235)
USD	426.515	CHF	390.000	16. Dez. 2020	2.089
USD	5.684.708	CLP	4.360.672.000	2. Okt. 2020	130.172
USD	1.947.190	CLP	1.518.029.000	7. Okt. 2020	13.415
USD	128.255	CLP	102.181.000	3. Nov. 2020	(1.938)
USD	3.390.389	CLP	2.660.472.000	4. Nov. 2020	523
USD	2.950.843	CLP	2.363.035.000	4. Dez. 2020	(61.140)
USD	5.357.185	CLP	4.159.458.000	16. Dez. 2020	54.748
USD	74.219	CNH	506.000	30. Okt. 2020	(215)
USD	7.750.974	CNH	53.144.000	4. Nov. 2020	(63.769)
USD	1.196.103	CNH	8.559.000	27. Nov. 2020	(60.459)
USD	280.386	CNH	1.962.000	3. Dez. 2020	(7.540)
USD	1.820.241	CNH	12.457.000	16. Dez. 2020	(6.259)
USD	5.730.597	COP	21.554.570.000	2. Okt. 2020	98.359
USD	45.142	COP	175.000.000	4. Nov. 2020	(507)
USD	4.512.202	COP	16.969.895.000	16. Dez. 2020	95.734
USD	1.679.973	CZK	37.820.000	2. Okt. 2020	41.287
USD	583.609	CZK	13.570.000	4. Nov. 2020	(4.443)
USD	2.204.498	CZK	50.070.000	16. Dez. 2020	33.178

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	3.853.358	DKK	24.215.000	16. Dez. 2020	33.887
USD	130.190.016	EUR	109.728.000	2. Okt. 2020	1.539.448
USD	324.519	EUR	300.000	9. Okt. 2020	(27.265)
USD	790.658	EUR	700.000	14. Okt. 2020	(30.260)
USD	45.573.604	EUR	39.071.000	30. Okt. 2020	(262.320)
USD	30.764.667	EUR	26.409.000	4. Nov. 2020	(220.175)
USD	179.069	EUR	160.000	27. Nov. 2020	(8.744)
USD	324.945	EUR	300.000	4. Dez. 2020	(27.268)
USD	1.018.970	EUR	900.000	15. Dez. 2020	(38.053)
USD	14.283.005	EUR	12.078.000	16. Dez. 2020	97.276
USD	451.116	EUR	400.000	15. Jan. 2021	(19.074)
USD	91.231.389	GBP	68.814.000	2. Okt. 2020	2.437.298
USD	5.097.243	GBP	4.002.000	30. Okt. 2020	(67.501)
USD	59.923.796	GBP	46.480.000	4. Nov. 2020	(62.008)
USD	282.364	HKD	2.189.000	4. Nov. 2020	(47)
USD	423.196	HKD	3.281.000	16. Dez. 2020	(32)
USD	4.721.756	HUF	1.470.707.000	2. Okt. 2020	(22.258)
USD	1.257.683	HUF	386.600.000	16. Dez. 2020	12.247
USD	2.007.037	IDR	29.945.000.000	2. Okt. 2020	(5.396)
USD	16.511	IDR	248.000.000	4. Nov. 2020	(104)
USD	2.458.196	IDR	37.110.000.000	16. Dez. 2020	(18.032)
USD	4.581.684	ILS	15.740.000	2. Okt. 2020	(12.997)
USD	2.603.859	ILS	8.982.000	4. Nov. 2020	(18.952)
USD	1.432.714	ILS	4.900.000	16. Dez. 2020	667
USD	1.286.218	INR	98.177.000	8. Okt. 2020	(43.605)
USD	1.058.903	INR	78.380.000	4. Nov. 2020	207
USD	1.837.862	INR	136.620.000	16. Dez. 2020	831
USD	94.922.153	JPY	10.016.265.000	2. Okt. 2020	(50.256)
USD	383.154	JPY	41.150.000	5. Okt. 2020	(7.035)
USD	521.474	JPY	55.750.000	13. Okt. 2020	(7.200)
USD	1.148.136	JPY	122.950.000	19. Okt. 2020	(17.875)
USD	1.534.287	JPY	164.000.000	26. Okt. 2020	(21.152)
USD	433.613	JPY	45.600.000	30. Okt. 2020	1.104
USD	1.830.638	JPY	190.800.000	2. Nov. 2020	20.870
USD	11.274.194	JPY	1.189.800.000	4. Nov. 2020	(11.491)
USD	1.100.027	JPY	116.050.000	9. Nov. 2020	(810)
USD	2.514.506	JPY	268.550.000	16. Nov. 2020	(33.127)
USD	2.052.166	JPY	216.650.000	24. Nov. 2020	(3.295)
USD	750.326	JPY	80.150.000	30. Nov. 2020	(10.145)
USD	942.824	JPY	100.000.000	7. Dez. 2020	(6.147)
USD	4.777.200	JPY	506.550.000	14. Dez. 2020	(30.705)
USD	1.325.564	JPY	139.700.000	16. Dez. 2020	(465)
USD	1.440.926	JPY	151.950.000	21. Dez. 2020	(1.571)
USD	507.917	JPY	54.300.000	12. Jan. 2021	(7.782)
USD	839.946	KRW	1.004.995.000	29. Okt. 2020	(19.389)
USD	4.812.922	KRW	5.640.680.000	4. Nov. 2020	(10.254)
USD	1.433.382	KRW	1.683.950.000	16. Dez. 2020	(6.600)
USD	19.066.901	MXN	415.397.000	2. Okt. 2020	280.432
USD	9.398.596	MXN	212.256.000	4. Nov. 2020	(162.291)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
USD	3.818.094	MXN	84.107.000	16. Dez. 2020	47.536	
USD	13.650.511	MXN	306.140.000	16. März. 2021	72.125	
USD	22.667.608	NOK	200.061.000	2. Okt. 2020	1.219.097	
USD	6.297.099	NOK	59.970.000	4. Nov. 2020	(132.547)	
USD	10.831.848	NZD	16.125.000	2. Okt. 2020	164.358	
USD	5.634.167	NZD	8.614.000	4. Nov. 2020	(64.359)	
USD	2.361.138	NZD	3.540.000	16. Dez. 2020	19.411	
USD	772.677	PEN	2.755.000	2. Okt. 2020	8.163	
USD	575.848	PEN	2.070.000	4. Nov. 2020	1.432	
USD	5.612.609	PEN	20.013.000	16. Dez. 2020	60.383	
USD	6.087.004	PHP	295.230.000	2. Okt. 2020	(2.724)	
USD	575.145	PHP	28.010.000	16. Dez. 2020	(837)	
USD	5.372.037	PLN	19.795.000	2. Okt. 2020	250.963	
USD	1.099.401	PLN	4.290.000	4. Nov. 2020	(10.525)	
USD	2.517.454	PLN	9.500.000	16. Dez. 2020	59.210	
USD	866.568	RON	3.580.000	16. Dez. 2020	10.037	
USD	2.011.734	RUB	147.033.000	1. Okt. 2020	119.539	
USD	12.425.760	RUB	934.553.000	2. Okt. 2020	398.825	
USD	1.062.040	RUB	80.269.000	29. Okt. 2020	32.104	
USD	6.829.268	RUB	540.163.000	5. Nov. 2020	(96.417)	
USD	985.135	RUB	77.171.000	27. Nov. 2020	(2.107)	
USD	1.117.376	RUB	88.090.000	30. Nov. 2020	(9.209)	
USD	7.665.328	RUB	588.175.000	16. Dez. 2020	159.658	
USD	13.348.956	SEK	116.597.000	2. Okt. 2020	329.869	
USD	223.746	SEK	2.034.000	30. Okt. 2020	(3.435)	
USD	8.420.628	SEK	76.236.000	4. Nov. 2020	(94.735)	
USD	1.204.547	SEK	10.634.000	16. Dez. 2020	15.995	
USD	8.550.587	SGD	11.709.000	2. Okt. 2020	(27.122)	
USD	3.972.399	SGD	5.466.000	4. Nov. 2020	(31.982)	
USD	2.752.258	SGD	3.765.000	16. Dez. 2020	(6.160)	
USD	14.503.177	THB	456.571.000	2. Okt. 2020	94.625	
USD	7.296.043	THB	231.271.000	4. Nov. 2020	(1.960)	
USD	3.001.583	THB	94.500.000	16. Dez. 2020	19.605	
USD	20.726.375	TRY	155.100.000	2. Okt. 2020	642.857	
USD	10.122.339	TRY	79.446.000	4. Nov. 2020	(74.467)	
USD	4.442.557	TRY	34.594.000	16. Dez. 2020	63.819	
USD	1.218.033	TRY	9.659.000	19. Jan. 2021	11.937	
USD	9.377.229	TWD	273.365.000	4. Nov. 2020	(61.926)	
USD	498.517	TWD	14.340.000	16. Dez. 2020	3.270	
USD	36.110.541	ZAR	604.959.000	2. Okt. 2020	(6.416)	
USD	20.716.021	ZAR	356.463.000	4. Nov. 2020	(479.620)	
USD	2.710.982	ZAR	46.125.000	17. Dez. 2020	(17.371)	
ZAR	604.959.000	USD	35.534.718	2. Okt. 2020	582.237	
ZAR	19.908.000	USD	1.173.544	3. Nov. 2020	10.344	
ZAR	142.120.000	USD	8.320.832	4. Nov. 2020	129.763	
ZAR	33.470.000	USD	1.988.424	17. Dez. 2020	(8.631)	
					USD	4.773.895

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	28.097.441	USD	5.127.576	30. Okt. 2020	(128.107)
CHF	58.377.399	USD	63.538.919	30. Okt. 2020	(106.806)
EUR	148.238.629	USD	173.646.157	30. Okt. 2020	259.159
GBP	45.301.634	USD	57.567.107	30. Okt. 2020	896.498
SGD	2.406.292	USD	1.762.921	30. Okt. 2020	(87)
USD	376.871	BRL	2.096.809	30. Okt. 2020	3.778
USD	241.877	CHF	222.695	30. Okt. 2020	(99)
USD	655.111	EUR	560.039	30. Okt. 2020	(1.897)
USD	1.009.561	GBP	793.717	30. Okt. 2020	(14.763)
USD	6.997	SGD	9.567	30. Okt. 2020	(10)
					USD 907.666
					USD 5.681.561

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	753.015
	UBS	(1.376.906)
		USD (623.891)
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	(181.382)
	HSBC	727.715
		USD 546.333
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	511.042
	Morgan Stanley	(18.670)
		USD 492.372
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(4.752.212)
	HSBC	(891.900)
		EUR (5.644.112)
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	(459.516)
	HSBC	318.678
	J.P. Morgan	(113.768)
		USD (254.606)
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	358.654
	Morgan Stanley	553.851
		USD 912.505
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	1.230.313
	Deutsche Bank	1.610.672
	HSBC	4.804.858
	Newedge Group	313.900
		USD 7.959.743

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	HSBC	(407.931)
		GBP (407.931)
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	(35.211)
	Barclays Bank	2.818.386
	BNP Paribas	688.463
	Brown Brothers Harriman & Co	(52)
	Citi Bank	2.829.077
	Credit Suisse	26.842
	Deutsche Bank	(15.081)
	Goldman Sachs	(69.972)
	HSBC	907.666
	J.P. Morgan	68.486
	Morgan Stanley	(1.412.462)
Standard Chartered Bank	(124.581)	
		USD 5.681.561

Kassageschäfte

Offene Kassageschäfte sind mit Bezug auf den Kassakurs, der sich auf das Fälligkeitsdatum des 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/(-verlust) aus Kassageschäften“ aufgeführt.

Zum 30. September 2020 wies der folgende Teilfonds offene Kassageschäfte auf:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
JPY	105.638.500	USD	1.000.327	1. Okt. 2020	1.318
THB	30.384.000	USD	960.091	1. Okt. 2020	(1.227)
THB	30.384.000	USD	959.303	2. Okt. 2020	(439)
USD	1.000.000	JPY	105.638.500	1. Okt. 2020	(1.645)
USD	1.000.000	JPY	105.655.000	2. Okt. 2020	(1.801)
					USD (3.794)

Die Kassageschäfte bezogen sich auf die folgenden Kontrahenten:

Kontrahenten von Kassageschäften

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citibank	(327)
	Deutsche Bank	(3.467)
		USD (3.794)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

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 2020 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
März 21	54	3 Month Euroswiss ICE Future	Morgan Stanley	CHF	14.768.878	100,78	2.633
Juni 21	34	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	10.015.463	100,53	2.682
Sep. 21	30	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	8.837.239	100,54	3.180
Dez. 21	28	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	8.248.230	100,54	3.239
März 23	337	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	99.235.492	100,50	32.374
Dez. 20	95	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	68.019.966	10,00	12.036
März 21	73	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	52.265.435	10,00	11.788
Juni 21	62	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	44.391.697	10,00	8.136
Sep. 21	11	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	7.875.590	10,00	1.412
Juni 21	22	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.488.975)	99,81	(575)
Sep. 21	18	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(4.490.813)	99,81	(638)
Dez. 21	16	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(3.990.200)	99,79	(1.400)
März 23	30	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	7.480.850	99,72	(1.850)
Juni 23	45	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	11.218.238	99,69	(3.112)
Sep. 23	44	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	10.965.688	99,66	(3.087)
Dez. 23	46	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	11.458.488	99,61	(3.338)
März 24	47	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	11.702.775	99,58	(2.713)
Juni 24	47	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	11.698.188	99,53	(4.000)
Sep. 24	41	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	10.199.138	99,48	(2.950)
Juni 21	10	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(1.612.696)	100,01	(323)
Sep. 21	8	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(1.290.439)	100,03	(298)
Dez. 21	7	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(1.129.234)	100,03	(161)
März 23	451	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	72.679.558	99,98	45.735
Okt. 20	1	Amsterdam Index Future	Credit Suisse	EUR	(126.343)	547,58	(2.059)
Dez. 20	610	Australia 3 Year Bond Future	Credit Suisse	AUD	51.128.925	117,31	123.680
Dez. 20	264	Australian 10 Year Bond Future	Credit Suisse	AUD	28.038.753	149,39	209.935
März 21	118	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	22.042.188	99,50	563
Juni 21	8	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	(1.494.330)	99,49	(19)
Sep. 21	7	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	(1.307.396)	99,48	38
Dez. 21	6	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	(1.120.386)	99,46	19
Okt. 20	1.017	BIST 30 Index Futures	Morgan Stanley	TRY	(1.630.222)	1.292,00	(71.197)
Okt. 20	5	Bovespa Index Future	Credit Suisse	BRL	91.226	94.587,00	(7.012)
Okt. 20	10	CAC 40 Index Future	Credit Suisse	EUR	590.631	4.801,00	(27.738)
Dez. 20	201	Canada 10 Year Bond Future	Credit Suisse	CAD	22.915.767	151,81	240
Okt. 20	4	CBOE VIX Future	Credit Suisse	USD	(121.400)	30,38	(100)
Nov. 20	2	CBOE VIX Future	Credit Suisse	USD	65.150	32,88	600
Dez. 20	1	Dax Index Future	Credit Suisse	EUR	(370.714)	12.779,00	(3.854)
Dez. 20	4	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Credit Suisse	USD	550.590	27.664,00	2.690
Dez. 20	10	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	1.661.190	3.352,00	14.810
Dez. 20	9	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Credit Suisse	EUR	2.322.553	222,68	27.177
Dez. 20	3	Euro Stoxx 50 Future	Credit Suisse	EUR	115.990	3.194,00	(3.646)
Dez. 20	71	Euro-BOBL Future	Credit Suisse	EUR	11.247.700	135,17	4.385
Dez. 20	88	Euro-BTP Future	Credit Suisse	EUR	15.017.431	147,58	209.224
Dez. 20	9	Euro-Bund Future	Credit Suisse	EUR	1.843.056	174,52	(1.512)
Dez. 20	115	Euro-OAT Future	Credit Suisse	EUR	22.642.213	168,55	83.678
Dez. 20	5	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	(376.769)	5.841,50	(110)
Okt. 20	174	FTSE China A50 Future	Credit Suisse	USD	2.632.344	15.120,00	(1.464)
Dez. 20	3	FTSE MIB Index Future	Credit Suisse	EUR	334.529	18.965,00	(997)
Dez. 20	3	FTSE/JSE Top 40 Future	Credit Suisse	ZAR	92.888	50.382,00	(2.651)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Okt. 20	1	Hang Seng Index Future	Credit Suisse	HKD	(151.289)	23.430,00	129
Okt. 20	19	HSCEI Index Future	Credit Suisse	HKD	(1.146.631)	9.380,00	(3.168)
Okt. 20	7	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	566.622	6.730,40	(14.248)
Dez. 20	13	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	18.763.097	152,11	(13.464)
Dez. 20	36	KOSPI2 Index Future	Credit Suisse	KRW	2.446.578	309,95	(61.327)
Dez. 20	72	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	12.680.372	136,11	(35.046)
Dez. 20	10	MSCI EAFE Index Future	Credit Suisse	USD	949.800	1.853,20	(23.200)
Dez. 20	36	MSCI Emerging Market Index Future	Credit Suisse	USD	1.986.730	1.088,50	(27.430)
Okt. 20	113	MSCI Singapore Index ETS Future	Credit Suisse	SGD	(2.349.595)	282,70	9.380
Dez. 20	3	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	662.916	11.407,25	21.519
Dez. 20	6	Nikkei 225 (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	1.318.808	23.190,00	492
Dez. 20	5	Nikkei 225 (SGX) Future	Credit Suisse	JPY	548.120	23.205,00	1.944
Okt. 20	37	OMXS30 Index Future	Credit Suisse	SEK	(752.588)	1.831,25	(3.971)
Dez. 20	2	Russell 2000 E-mini Future	Credit Suisse	USD	154.420	1.504,40	(3.980)
Dez. 20	1	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	184.895	1.855,90	695
Dez. 20	24	S&P/TSX 60 Index Future	Credit Suisse	CAD	3.503.807	961,50	(37.771)
Dez. 20	430	SET 50 Index Future	Credit Suisse	THB	(2.136.147)	778,60	23.024
Okt. 20	31	SGX Nifty 50 Future	Credit Suisse	USD	694.272	11.254,00	3.476
Dez. 20	212	Short-Term Euro-BTP Future	Credit Suisse	EUR	28.077.094	113,27	77.229
Dez. 20	103	South Korea 10 Year Bond Future	Credit Suisse	KRW	11.659.171	133,12	64.951
Dez. 20	584	South Korea 3 Year Bond Future	Credit Suisse	KRW	55.785.293	112,08	182.830
Dez. 20	6	SPI 200 Future	Credit Suisse	AUD	(624.283)	5.802,00	931
Dez. 20	6	Swiss Market Index Future	Credit Suisse	CHF	667.488	10.184,00	(4.071)
Dez. 20	18	Topix Index Future	Credit Suisse	JPY	2.756.698	1.625,50	17.587
Dez. 20	10	WIG20 Index Future	Credit Suisse	PLN	90.143	1.712,00	(1.563)
						USD	828.398
Schroder GAIA Helix							
Dez. 20	2	Dax Index Future	Goldman Sachs	EUR	(760.583)	12.779,00	11.446
Dez. 20	13	E-mini S&P 500 Future	J.P. Morgan	USD	(2.177.840)	3.352,00	(960)
Dez. 20	48	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(1.828.802)	3.194,00	31.296
Dez. 20	236	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(5.051.126)	353,40	161.868
Dez. 20	23	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(1.777.431)	5.841,50	43.788
Dez. 20	132	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(5.894.393)	17.225,50	26.486
Dez. 20	92	MSCI AC AXJ NTR Future	J.P. Morgan	USD	(5.008.459)	534,48	91.243
Dez. 20	113	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	(6.070.145)	1.071,60	15.605
Dez. 20	53	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(5.007.649)	1.853,20	96.669
Dez. 20	68	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(3.794.740)	1.088,50	93.840
Dez. 20	97	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(2.486.086)	212,80	65.962
Dez. 20	59	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(998.874)	158,60	63.134
Dez. 20	15	MSCI Russia Future	Goldman Sachs	USD	(504.000)	642,60	22.050
Dez. 20	73	MSCI Saudi Arabia Future	Goldman Sachs	USD	(838.445)	1.158,00	(6.895)
Dez. 20	172	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(12.196.110)	7.061,00	51.190
Dez. 20	16	Stoxx 600 Auto Future	J.P. Morgan	EUR	(415.985)	427,80	14.726
Dez. 20	369	Stoxx Europe 600 Future	J.P. Morgan	EUR	(7.939.773)	360,10	150.197
Dez. 20	54	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(8.231.973)	1.625,50	(90.883)
						USD	840.762
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Sep. 21	1.031	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(257.313.538)	99,81	53.263
März 22	9	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(2.246.288)	99,78	1.238
Sep. 22	11	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	2.743.600	99,76	(200)
März 23	18	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	4.488.113	99,72	(712)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Juni 23	37	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	9.222.538	99,69	(1.212)
Sep. 23	15	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	3.737.950	99,66	(700)
Okt. 20	25	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	(3.253.012)	547,58	42.961
Dez. 20	49	Australian 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	5.227.252	149,39	15.876
Dez. 20	11	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	801.170	71,63	(13.240)
Juni 21	30	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(5.603.185)	99,49	(623)
Dez. 20	9	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	728.613	129,04	(2.763)
Okt. 20	125	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	(7.383.129)	4.801,00	346.963
Dez. 20	295	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	33.652.443	151,81	(19.496)
Dez. 20	11	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	833.675	75,13	(7.245)
Okt. 20	285	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(9.064.930)	30,38	408.055
Nov. 20	85	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(2.742.350)	32,88	(52.025)
Dez. 20	38	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	14.646.300	12.779,00	(412.699)
Dez. 20	89	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(12.120.675)	27.664,00	(189.805)
Okt. 20	6	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	162.262	135,35	158
Dez. 20	518	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	86.210.548	3.352,00	606.253
Dez. 20	80	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(20.461.597)	222,68	(424.896)
Dez. 20	5	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	740.663	1,17	(7.194)
Dez. 20	594	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	(22.964.954)	3.194,00	720.811
Dez. 20	110	Euro Stoxx Bank Future	Credit Suisse	EUR	(392.332)	54,60	40.245
Dez. 20	39	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	6.186.901	135,17	(6.179)
Dez. 20	30	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	5.181.971	147,58	8.934
Dez. 20	32	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(6.517.696)	174,52	(30.015)
Dez. 20	327	Euro-OAT Future	Credit Suisse	EUR	64.108.967	168,55	511.610
Dez. 20	3	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(394.805)	112,29	(158)
Dez. 20	11	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	(821.230)	5.841,50	(7.903)
Okt. 20	297	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	4.518.891	15.120,00	(28.251)
Dez. 20	3	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	350.557	18.965,00	(17.024)
Dez. 20	55	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	1.720.696	50.382,00	(66.361)
Okt. 20	11	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(908.379)	6.730,40	40.363
Dez. 20	96	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	(138.249.467)	152,11	(209.359)
Dez. 20	6	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(712.319)	94,88	756
Dez. 20	60	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	697.431	1.291,20	(34.994)
Dez. 20	491	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	33.109.032	309,95	(576.870)
Dez. 20	804	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	141.417.348	136,11	(211.204)
Dez. 20	32	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	740.095	4,49	(22.495)
Dez. 20	66	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	6.242.060	1.853,20	(126.500)
Dez. 20	15	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	816.425	1.088,50	(50)
Okt. 20	101	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(2.119.329)	282,70	27.633
Okt. 20	20	MSCI Taiwan Index Future	Newedge Group	USD	978.600	493,00	7.400
Dez. 20	235	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	52.447.982	11.407,25	1.166.093
Dez. 20	7	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	463.800	66,13	(890)
Dez. 20	121	Nikkei 225 (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	26.163.751	23.190,00	442.137
Dez. 20	48	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	5.251.600	23.265,00	42.668
Okt. 20	158	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	(3.230.474)	1.831,25	(236)
Dez. 20	2.876	RTS Index Future	Credit Suisse	USD	7.063.609	116.370,00	(370.007)
Dez. 20	28	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2.103.655	1.504,40	2.505
Dez. 20	32	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	5.936.690	1.855,90	2.190
Dez. 20	147	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	21.537.086	961,50	(307.617)
Dez. 20	100	SET 50 Index Future	Credit Suisse	THB	494.385	778,60	(2.961)
Okt. 20	58	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	1.301.449	11.254,00	4.015

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Dez. 20	110	Short-Term Euro-BTP Future	Credit Suisse	EUR	14.582.687	113,27	25.688
Dez. 20	45	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	5.071.227	133,12	50.962
Dez. 20	22	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	2.100.547	112,08	7.841
Dez. 20	169	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	(17.892.408)	5.802,00	334.650
Dez. 20	5	Stoxx 600 Bank Future	Credit Suisse	EUR	(26.116)	82,60	1.905
Dez. 20	15	Stoxx Europe 600 Future	Credit Suisse	EUR	(322.488)	360,10	5.839
Dez. 20	6	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	827.913	108,77	(12.138)
Okt. 20	191	TAIEX Future	Newedge Group	TWD	16.840.142	12.473,00	(388.633)
Dez. 20	5	Topix Index Future	Credit Suisse	JPY	766.937	1.625,50	3.698
Dez. 20	9	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	(840.067)	93,93	(5.276)
Dez. 20	1.386	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(193.082.525)	139,53	(307.788)
Dez. 20	1.065	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(235.216.805)	110,48	(106.594)
Dez. 20	398	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	50.159.180	126,03	1.258
Okt. 20	53	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	(532.264)	1.170,00	2.038
Dez. 20	191	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(33.701.922)	176,28	32.203
Dez. 20	140	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(30.999.281)	221,81	(54.469)
Okt. 20	10	VSTOXX Mini Future	Credit Suisse	EUR	(30.613)	26,55	(516)
Dez. 20	15	WIG20 Index Future	Credit Suisse	PLN	134.998	1.712,00	(2.127)
						USD	928.784
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
Dez. 20	46	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	(2.668.000)	5.841,50	(19.090)
						GBP	(19.090)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Dez. 20	5	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(419.856)	117,31	(247)
Dez. 20	68	Australian 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(7.249.906)	149,39	(26.272)
Dez. 20	88	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	10.053.254	151,81	(20.375)
Dez. 20	3	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	291.375	129,73	909
Okt. 20	31	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(939.700)	30,38	(1.925)
Dez. 20	20	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(3.358.568)	3.352,00	6.567
Dez. 20	13	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(3.356.208)	222,68	(37.847)
Dez. 20	37	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(1.408.746)	3.194,00	23.168
Dez. 20	82	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(12.994.146)	135,17	(1.219)
Dez. 20	92	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(15.618.511)	147,58	(300.264)
Dez. 20	88	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(17.964.138)	174,52	(42.068)
Dez. 20	10	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	1.967.512	168,55	8.653
Dez. 20	168	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	22.122.537	112,29	(4.596)
Dez. 20	150	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	26.439.116	136,11	(94.686)
Dez. 20	39	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(3.711.930)	1.853,20	98.190
Dez. 20	17	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(924.010)	1.088,50	(1.215)
Dez. 20	14	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.046.205)	1.504,40	(6.875)
Dez. 20	85	S&P500 Micro E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.415.861)	3.352,00	(8.739)
Okt. 20	79	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(1.797.491)	11.254,00	19.359
Dez. 20	23	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	3.205.844	139,53	3.375
Dez. 20	18	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(2.864.430)	159,92	(14.164)
Dez. 20	344	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	75.994.055	110,48	16.508
Dez. 20	2	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	252.344	126,03	(281)
Dez. 20	41	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	7.254.188	176,28	(26.656)
Dez. 20	149	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(33.214.383)	221,81	164.320
						USD	(246.380)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 30. September 2020 wiesen die folgenden Teilfonds offene Optionskontrakte auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend						
(572.298)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1Basket on Commodity Future Ausübungskurs 61,84 Läuft am 18. Nov. 2020 ab	UBS	USD	(1.973)	-	1.973
				USD	-	1.973
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
(1.425)	Call auf Grubhub, Inc. Ausübungskurs 75,00 Läuft am 15. Jan. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(893.476)	(673.313)	220.163
(717)	Call auf Stitch Fix, Inc. Ausübungskurs 30,00 Läuft am 19. März. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(252.384)	(274.252)	(21.868)
(1.443)	Call auf Stitch Fix, Inc. Ausübungskurs 30,00 Läuft am 19. März. 2021 ab	Barclays Bank	USD	(507.936)	(551.948)	(44.012)
				USD	(1.499.513)	154.283
Schroder GAIA Egerton Equity						
(542.700)	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 1,11 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	(121.063)	(69.443)	51.620
(542.700)	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 1,39 Läuft am 19. März. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	(136.462)	(59.800)	76.662
(542.700)	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 1,67 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	GBP	(138.826)	(38.408)	100.418
542.700	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 1,67 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	254.919	138.823	(116.096)
542.700	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 1,94 Läuft am 19. März. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	270.317	117.866	(152.451)
542.700	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 2,22 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	GBP	272.681	81.042	(191.639)
				EUR	170.080	(231.486)
Schroder GAIA Helix						
4.000	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 67,50 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Goldman Sachs	EUR	106.268	11.725	(94.543)
(8)	Call auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.170,00 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	(11.840)	(7.520)	4.320
280	Put auf Deutsche Börse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 11.900,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Goldman Sachs	EUR	266.284	87.817	(178.467)
(185)	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 5.200,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	GBP	(267.334)	(207.085)	60.249
320	Put auf FTSE 250 Index Ausübungskurs 15.000,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	GBP	320.763	256.418	(64.345)
8	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.030,00 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	15.920	18.000	2.080

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)						
40	Put auf Nikkei-225 Stock Average Index Ausübungskurs 22.250,00 Läuft am 9. Okt. 2020 ab	Goldman Sachs	JPY	44.093	19.153	(24.940)
				USD	178.508	(295.646)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
(2)	Call auf Amazon.Com, Inc. Ausübungskurs 3.300,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(27.163)	(9.200)	17.963
442	Call auf East Japan Railway Co. Ausübungskurs 7.949,70 Läuft am 8. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	JPY	438	-	(438)
16.864	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 110,06 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	EUR	48.423	46	(48.377)
16.865	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 114,85 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	45.202	662	(44.540)
140.427	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 120,00 Läuft am 17. Dez. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	309.198	16.570	(292.628)
61.046	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 120,64 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	71.265	1.758	(69.507)
28.782	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 70,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	EUR	96.915	14.031	(82.884)
1.290.000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 78,22 Läuft am 1. Okt. 2020 ab	Bank of America	AUD	10.456	-	(10.456)
450.000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 86,00 Läuft am 22. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	AUD	24.705	-	(24.705)
665.000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 93,00 Läuft am 21. Okt. 2021 ab	J.P. Morgan	AUD	31.945	700	(31.245)
1.152.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Läuft am 21. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	11.688	14.059	2.371
1.161.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,65 Läuft am 29. Okt. 2020 ab	Deutsche Bank	EUR	12.311	8.311	(4.000)
(993.000)	Call auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 6,49 Läuft am 27. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	(27.603)	(35.426)	(7.823)
993.000	Call auf EUR/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,97 Läuft am 27. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	8.455	8.763	308
1.148.000	Call auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 125,60 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	11.964	288	(11.676)
1.149.000	Call auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 125,65 Läuft am 14. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	11.475	957	(10.518)
1.152.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,76 Läuft am 21. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	12.307	13.581	1.274
958.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,77 Läuft am 1. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	10.493	1.333	(9.160)
1.318.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,16 Läuft am 26. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	20.657	16.891	(3.766)
853.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,18 Läuft am 7. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	15.873	9.021	(6.852)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (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.)						
1.148.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,18 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	11.615	1.215	(10.400)
1.149.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,19 Läuft am 14. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	11.241	1.528	(9.713)
1.025.000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,81 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	GBP	12.904	4.985	(7.919)
1.042.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,91 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Bank of America	USD	17.813	19.000	1.187
1.739.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,94 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	20.953	91	(20.862)
7.522.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,17 Läuft am 21. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	126.057	28.830	(97.227)
1.238.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,17 Läuft am 21. Jan. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	17.802	4.745	(13.057)
3.521.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,03 Läuft am 8. Feb. 2021 ab	Citi Bank	USD	61.547	25.541	(36.006)
1.770.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,06 Läuft am 9. Feb. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	31.488	11.712	(19.776)
(7.042.000)	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,27 Läuft am 8. Feb. 2021 ab	Citi Bank	USD	(53.343)	(23.727)	29.616
(1.770.000)	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,31 Läuft am 9. Feb. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(13.656)	(5.550)	8.106
997.000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4,035,00 Läuft am 4. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	12.153	4.295	(7.858)
962.000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.825,00 Läuft am 23. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	21.645	21.736	91
1.784.000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.295,00 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	18.036	963	(17.073)
956.000	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,40 Läuft am 18. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	10.813	14.099	3.286
926.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,00 Läuft am 4. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	13.705	11.635	(2.070)
935.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,29 Läuft am 22. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	10.860	1.065	(9.795)
2.145.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,98 Läuft am 21. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	10.275	451	(9.824)
1.042.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 105,60 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Deutsche Bank	USD	17.306	9.924	(7.382)
1.738.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 105,63 Läuft am 29. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	12.227	9.206	(3.021)
1.337.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 105,87 Läuft am 1. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	11.384	173	(11.211)
1.739.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 107,45 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	21.424	60	(21.364)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (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.)						
800.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Jun. 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	77.965	22.696
962.000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 48,77 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	9.535	5.222	(4.313)
1.249.000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 49,76 Läuft am 8. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	12.062	30	(12.032)
2.690.000	Call auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 80,63 Läuft am 27. Nov. 2020 ab	Citi Bank	USD	37.552	48.628	11.076
3.537.000	Call auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 81,45 Läuft am 10. Feb. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	64.409	106.535	42.126
2.726.000	Call auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 90,10 Läuft am 30. Sept. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	69.240	-	(69.240)
962.000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Bank of America	USD	9.730	7.294	(2.436)
1.427.000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,39 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	12.005	43	(11.962)
964.000	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 31,19 Läuft am 18. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	11.192	18.749	7.557
1.267.000	Call auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 7,44 Läuft am 18. Jan. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	55.431	103.365	47.934
3.379.000	Call auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 7,79 Läuft am 9. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	131.089	132.170	1.081
(3.379.000)	Call auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 8,47 Läuft am 9. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	(65.120)	(54.129)	10.991
2.548.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 16,87 Läuft am 25. Jan. 2021 ab	Citi Bank	USD	115.424	111.102	(4.322)
2.589.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,02 Läuft am 30. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	36.220	10.486	(25.734)
1.115.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,35 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	15.337	109	(15.228)
(2.548.000)	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,39 Läuft am 25. Jan. 2021 ab	Citi Bank	USD	(50.986)	(44.558)	6.428
2.625	Call auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 18.760,30 Läuft am 29. Jun. 2021 ab	J.P. Morgan	CNY	195.401	70.791	(124.610)
(2.625)	Call auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 23.370,88 Läuft am 29. Jun. 2021 ab	J.P. Morgan	CNY	(42.694)	(12.173)	30.521
770.865	Call auf Hon Hai Precision Industry Co., Ltd. Ausübungskurs 100,80 Läuft am 16. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	TWD	31.713	1.438	(30.275)
15.554	Call auf Hon Hai Precision Industry Co., Ltd. Ausübungskurs 87,34 Läuft am 18. Nov. 2020 ab	Goldman Sachs	TWD	440	142	(298)
191.821	Call auf HSBC Holdings PLC Ausübungskurs 3,82 Läuft am 19. März. 2021 ab	J.P. Morgan	GBP	19.620	11.001	(8.619)
358	Call auf JPMorgan Chase & Co. Ausübungskurs 105,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	95.438	14.320	(81.118)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (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.)						
(358)	Call auf JPMorgan Chase & Co. Ausübungskurs 115,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(27.449)	(2.327)	25.122
164	Call auf Keyence Corp. Ausübungskurs 54.944,13 Läuft am 13. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	JPY	445	394	(51)
165	Call auf Keyence Corp. Ausübungskurs 57.333,00 Läuft am 11. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	JPY	500	432	(68)
(8)	Call auf Netflix, Inc. Ausübungskurs 550,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(9.143)	(2.740)	6.403
(31)	Call auf PayPal Holdings, Inc. Ausübungskurs 220,00 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(22.309)	(15.810)	6.499
1.707	Call auf Rohm Co., Ltd. Ausübungskurs 8.495,37 Läuft am 25. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	JPY	672	4.539	3.867
(573)	Call auf S&P Biotechnology Select Industry Index Ausübungskurs 10.102,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	(280.286)	(94.107)	186.179
590	Call auf Samsung Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 64.460,00 Läuft am 11. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	KRW	365	152	(213)
936	Call auf Samsung Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 70.320,00 Läuft am 11. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	KRW	347	112	(235)
161.169	Call auf Standard Chartered PLC Ausübungskurs 4,52 Läuft am 19. März. 2021 ab	J.P. Morgan	GBP	35.726	17.259	(18.467)
(8)	Call auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 660,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(29.503)	(12.660)	16.843
11.143	Call auf The Nikkei-225 Stock Average Ausübungskurs 24.811,84 Läuft am 7. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	JPY	42.064	36.440	(5.624)
648	Call auf The Nikkei-225 Stock Average Ausübungskurs 24.906,05 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Goldman Sachs	JPY	832	3	(829)
(1.878)	Call auf The S&P North American Technology Index Ausübungskurs 1.400,00 Läuft am 15. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(91.083)	(45.644)	45.439
196.630	Call auf TOPIX Banks Index Ausübungskurs 132,19 Läuft am 1. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	JPY	2.519	920	(1.599)
1.628.059	Call auf TOPIX Banks Index Ausübungskurs 134,54 Läuft am 30. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	JPY	20.422	4.955	(15.467)
60.756	Call auf TOPIX Banks Index Ausübungskurs 134,68 Läuft am 30. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	JPY	771	180	(591)
29.026	Call auf Volkswagen AG Ausübungskurs 1,64 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	66.934	41.283	(25.651)
(393)	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 100,00 Läuft am 14. Dez. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	(2.689)	-	2.689
392	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 100,25 Läuft am 14. Dez. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	19.934	2.872	(17.062)
2	Put auf Amazon.Com, Inc. Ausübungskurs 2.800,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	29.227	2.525	(26.702)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (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.)						
151	Put auf Apple, Inc. Ausübungskurs 105,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	56.962	11.627	(45.335)
68	Put auf Apple, Inc. Ausübungskurs 87,50 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	26.234	578	(25.656)
43	Put auf Carvana Co. Ausübungskurs 170,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	34.537	6.299	(28.238)
(101)	Put auf Cisco Systems, Inc. Ausübungskurs 39,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(6.229)	(8.030)	(1.801)
(9)	Put auf Credit Acceptance Corp. Ausübungskurs 350,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(17.610)	(19.980)	(2.370)
1.290.000	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 78,22 Läuft am 1. Okt. 2020 ab	Bank of America	AUD	10.393	32.810	22.417
1.152.000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Läuft am 21. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	11.688	5.548	(6.140)
1.161.000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,65 Läuft am 29. Okt. 2020 ab	Deutsche Bank	EUR	12.311	16.170	3.859
(993.000)	Put auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 6,49 Läuft am 27. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	(27.604)	(18.174)	9.430
993.000	Put auf EUR/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,97 Läuft am 27. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	8.454	9.328	874
1.148.000	Put auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 125,60 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	11.964	21.638	9.674
1.149.000	Put auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 125,65 Läuft am 14. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	11.474	22.776	11.302
1.152.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,76 Läuft am 21. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	12.308	5.312	(6.996)
958.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,77 Läuft am 1. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	10.492	2.138	(8.354)
1.318.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,16 Läuft am 26. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	20.657	5.946	(14.711)
853.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,18 Läuft am 7. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	EUR	15.873	18.093	2.220
1.148.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,18 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	EUR	11.615	13.683	2.068
1.149.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,19 Läuft am 14. Okt. 2020 ab	Bank of America	EUR	11.241	19.902	8.661
1.025.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,81 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	GBP	12.903	8.595	(4.308)
3.864.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,64 Läuft am 7. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	22.179	5.857	(16.322)
(3.865.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,97 Läuft am 7. Jan. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(66.803)	(23.460)	43.343
5.218.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,05 Läuft am 14. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	68.392	492	(67.900)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (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.)						
5.038.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,28 Läuft am 30. Dez. 2020 ab	BNP Paribas	USD	77.586	85.695	8.109
(2.606.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,30 Läuft am 4. Feb. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(136.690)	(58.890)	77.800
(5.218.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,36 Läuft am 14. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	(199.766)	(13.527)	186.239
5.218.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,36 Läuft am 14. Okt. 2020 ab	BNP Paribas	USD	11.114	13.527	2.413
(5.038.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,67 Läuft am 30. Dez. 2020 ab	BNP Paribas	USD	(224.191)	(244.931)	(20.740)
1.042.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,91 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Bank of America	USD	17.866	5.463	(12.403)
1.739.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,94 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	21.009	36.054	15.045
(3.591.000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 735,70 Läuft am 25. Feb. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(42.984)	(32.534)	10.450
(2.456.000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 738,60 Läuft am 4. Dez. 2020 ab	Bank of America	USD	(30.035)	(8.794)	21.241
962.000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.825,00 Läuft am 23. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	21.645	13.123	(8.522)
956.000	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,40 Läuft am 18. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	10.813	6.445	(4.368)
926.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 74,00 Läuft am 4. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	13.705	10.784	(2.921)
935.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,29 Läuft am 22. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	10.860	20.902	10.042
1.042.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 105,60 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Deutsche Bank	USD	17.307	11.772	(5.535)
1.738.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 105,63 Läuft am 29. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	12.227	12.373	146
1.337.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 105,87 Läuft am 1. Okt. 2020 ab	Bank of America	USD	11.324	5.244	(6.080)
1.739.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 107,45 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	21.425	32.819	11.394
4.952.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Jun. 2024 ab	BNP Paribas	USD	313.305	170.414	(142.891)
3.408.000	Put auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1.167,50 Läuft am 27. Okt. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	18.966	32.515	13.549
3.387.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,26 Läuft am 21. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	14.530	20.974	6.444
(2.659.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 21,22 Läuft am 24. Nov. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	(26.899)	(27.544)	(645)
3.387.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 21,37 Läuft am 21. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	45.758	62.566	16.808

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(3.387.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,75 Läuft am 21. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(138.596)	(168.176)	(29.580)
962.000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 48,77 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	9.535	9.316	(219)
1.249.000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 49,76 Läuft am 8. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	12.062	33.099	21.037
(3.537.000)	Put auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 70,53 Läuft am 10. Feb. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(48.934)	(20.023)	28.911
(2.690.000)	Put auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 72,20 Läuft am 27. Nov. 2020 ab	Citi Bank	USD	(28.110)	(10.131)	17.979
962.000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Läuft am 19. Nov. 2020 ab	Bank of America	USD	9.731	7.850	(1.881)
1.427.000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,39 Läuft am 7. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	12.004	30.101	18.097
964.000	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 31,19 Läuft am 18. Nov. 2020 ab	J.P. Morgan	USD	11.192	3.977	(7.215)
(2.589.000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 16,12 Läuft am 30. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(28.700)	(14.791)	13.909
(59)	Put auf GSX Techedu, Inc. Ausübungskurs 75,00 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(38.888)	(41.300)	(2.412)
17	Put auf Hang Seng Index Ausübungskurs 21.343,74 Läuft am 30. Dez. 2020 ab	J.P. Morgan	HKD	879	887	8
25	Put auf Hang Seng Index Ausübungskurs 22.534,04 Läuft am 29. Okt. 2020 ab	J.P. Morgan	HKD	803	751	(52)
(595)	Put auf iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF Ausübungskurs 91,50 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Barclays Bank	USD	(417)	(705)	(288)
595	Put auf iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF Ausübungskurs 97,50 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Barclays Bank	USD	1.011	1.594	583
841	Put auf MSCI Emerging Markets Ausübungskurs 920,00 Läuft am 30. Sept. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	32.041	-	(32.041)
1	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.060,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	1.733	1.080	(653)
2	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.830,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	9.287	13.730	4.443
(3)	Put auf Netflix, Inc. Ausübungskurs 420,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(1.874)	(372)	1.502
31	Put auf PayPal Holdings, Inc. Ausübungskurs 175,00 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	27.856	15.733	(12.123)
55	Put auf Roku, Inc. Ausübungskurs 135,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	26.698	1.183	(25.515)
27	Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 1.260,00 Läuft am 15. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	98.640	87.480	(11.160)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (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.)						
569	Put auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 1.385,00 Läuft am 30. Sept. 2020 ab	Credit Suisse	USD	33.276	-	(33.276)
12	Put auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 1.490,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	90.890	105.840	14.950
(8)	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 2.950,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(14.662)	(3.160)	11.502
8	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.300,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	58.272	37.280	(20.992)
573	Put auf S&P Biotechnology Select Industry Index Ausübungskurs 8.554,90 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Goldman Sachs	USD	414.227	342.262	(71.965)
(9)	Put auf Spotify Technology S.A. Ausübungskurs 215,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(5.508)	(1.553)	3.955
156	Put auf Sunrun, Inc. Ausübungskurs 38,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	67.599	2.730	(64.869)
10	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 220,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	3.079	300	(2.779)
8	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 320,00 Läuft am 18. Dez. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	24.433	15.680	(8.753)
6	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 330,00 Läuft am 2. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	17.690	54	(17.636)
14	Put auf The NASDAQ-100 Recuded Value Index Ausübungskurs 1.885,00 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	55.697	30.520	(25.177)
1.878	Put auf The S&P North American Technology Index Ausübungskurs 1.145,00 Läuft am 15. Jan. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	118.314	80.614	(37.700)
(12)	Put auf The Walt Disney Co. Ausübungskurs 110,00 Läuft am 20. Nov. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	(3.380)	(2.406)	974
30	Put auf Wayfair, Inc. Ausübungskurs 230,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	45.186	4.800	(40.386)
10	Put auf Wayfair, Inc. Ausübungskurs 260,00 Läuft am 16. Okt. 2020 ab	Morgan Stanley	USD	16.805	5.500	(11.305)
				USD	1.612.972	(1.187.061)

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 2020 wiesen die folgenden Teilfonds offene Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Schutzposition	beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	IRS „Zahlte Festzinssatz 8,50 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Put, 8,50 %, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	30.826	(65.099)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Swaptions (Forts.)

Schutz- position	beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nenn- betrag	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 10,09 % Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mar 2023“, Put, 10,09 %, 6. März. 2023	J.P. Morgan	ZAR	213.907	48.950.000	71.426	(142.481)
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 10,97 % Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mar 2023“, Put, 10,97 %, 6. März. 2023	J.P. Morgan	ZAR	213.954	48.950.000	54.570	(159.384)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,74 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2021“, Call, 5,74 %, 2. März. 2021	J.P. Morgan	MXN	98.202	524.480.000	290.692	192.490
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,74 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2021“, Call, 5,74 %, 16. März. 2021	J.P. Morgan	MXN	99.429	524.480.000	289.189	189.760
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,97 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2023“, Call, 5,97 %, 30. März. 2023	J.P. Morgan	MXN	69.383	46.495.000	31.053	(38.330)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2025“, Call, 6,80 %, 7. Feb. 2025	J.P. Morgan	MXN	541.677	228.495.000	254.829	(286.848)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,71 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Jan 2019“, Put, 7,71 %, 11. Jan. 2021	J.P. Morgan	ZAR	33.881	36.132.471	74.305	40.424
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,50 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Call, 8,50 %, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	61.034	(34.891)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 10,09 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mar 2023“, Call, 10,09 %, 6. März. 2023	J.P. Morgan	ZAR	213.907	48.950.000	332.740	118.833
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 10,97 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mar 2023“, Call, 10,97 %, 6. März. 2023	J.P. Morgan	ZAR	213.954	48.950.000	446.013	232.059
USD						1.936.677	46.533

Total Return Swap-Kontrakte

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

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

Zum 30. September 2020 waren folgende Teilfonds in Total Return Swaps-Vereinbarungen engagiert:

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	44.929.137	2.654.725	3. Dez. 2020	2.832.970
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	14.921.821	3.000.071	21. Dez. 2020	3.000.071
Kauf Long	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	EUR	12.447.062	1.092.152	3. Dez. 2020	1.316.284
Kauf Long	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	4.604.903	577.212	6. Apr. 2021	578.111
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	14.741.525	3.266.452	3. Dez. 2020	3.265.018
Kauf Long	Getränke	Morgan Stanley	USD	6.713.426	4.519.711	3. Aug. 2021	4.663.219
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	2.238.445	277.305	8. März. 2021	325.843
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	3.495.138	256.307	8. Dez. 2020	313.530
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	EUR	27.558.686	2.276.530	3. Dez. 2020	2.319.160
Kauf Long	Wohngebäude-Bausträger	Morgan Stanley	GBP	27.922.890	(1.252.879)	8. Dez. 2020	(1.211.749)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	PLN	1.016.783	-	16. Okt. 2023	-
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	EUR	6.693.073	1.911.391	3. Dez. 2020	1.918.304
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	4.438.963	548.441	31. Jul. 2023	549.448
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	21.020.445	528.163	25. Jan. 2021	(448.929)
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Merrill Lynch	USD	6.377.149	1.039.413	30. Jul. 2021	1.153.964
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	HKD	153.232	178	23. Dez. 2020	178
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	4.740.976	(597.802)	15. Mai 2023	(621.997)
Verkauf Short	Bekleidung	Merrill Lynch	USD	5.026.587	(2.009.673)	31. März. 2021	(2.060.455)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	GBP	6.301.717	(650.481)	8. Dez. 2020	(669.613)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	1.965.478	(7.296)	19. Jul. 2023	(7.847)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	1.467.722	(48.657)	25. Jul. 2023	(48.657)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CAD	2.430.185	(281.284)	26. Apr. 2021	(282.308)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CAD	2.624.742	(299.676)	30. Apr. 2021	(305.539)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	CAD	1.841.348	128.079	30. Nov. 2020	129.909
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	HKD	5.241.922	477.502	23. Dez. 2020	492.117
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	10.280.041	505.346	24. Okt. 2022	529.071
Verkauf Short	Banken	UBS	AUD	7.793.007	599.387	2. März. 2023	602.438
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	USD	2.439.048	192.971	1. Aug. 2023	192.783
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	2.738.386	(769.941)	30. Nov. 2020	(793.285)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	4.782.763	72.680	26. Apr. 2023	86.813
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	9.069.047	584.295	18. Okt. 2021	433.409
Verkauf Short	Chemie	J.P. Morgan	USD	8.342.058	121.708	23. Apr. 2021	121.071
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	SEK	2.571.849	(552.265)	17. Mai 2023	(546.732)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.792.090	(46.378)	13. Sep. 2023	(46.378)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	5.971.626	81.960	14. Jun. 2023	81.132
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	4.596.831	89.741	30. Jun. 2021	88.161
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	EUR	6.041.860	169.859	3. Dez. 2020	169.849
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	6.501.740	(333.388)	13. Jul. 2021	(327.855)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	10.892.673	630.940	24. Okt. 2022	637.452
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	USD	3.006.407	40.920	23. Sep. 2021	40.920
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	GBP	3.883.370	(561.349)	8. Dez. 2020	(564.062)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.057.932	(296.343)	27. Sep. 2023	(296.343)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	GBP	5.829.930	171.006	8. Dez. 2020	188.936
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	5.056.086	284.333	13. Jul. 2021	262.509
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	3.393.356	(683.003)	26. Apr. 2023	(693.231)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	USD	5.481.426	(388.378)	2. Jul. 2021	(403.822)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	HKD	6.155.217	843.051	23. Dez. 2020	748.563
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	3.691.896	(1.862.337)	24. Okt. 2022	(1.940.088)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	3.644.450	(1.640.426)	23. Sep. 2021	(1.640.426)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	2.501.888	(192.381)	27. Sep. 2023	(192.381)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	1.829.036	453.712	6. Jun. 2023	454.021
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	CAD	5.961.475	314.448	5. Apr. 2021	318.382
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	UBS	EUR	9.338.878	170.867	7. Mai. 2021	280.729
Verkauf Short	Umweltschutz	J.P. Morgan	USD	5.435.515	(381.468)	20. Aug. 2021	(785.354)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	NOK	2.786.539	60.357	26. Apr. 2023	59.616
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	2.798.786	108.468	31. Aug. 2021	14.383
Verkauf Short	Lebensmitteldienstleistungen	Goldman Sachs	USD	547.429	58.718	15. Aug. 2023	58.970
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	HKD	8.790.868	694.745	23. Dez. 2020	675.088
Verkauf Short	Gas	UBS	EUR	3.534.891	(236.311)	7. Mai. 2021	(239.195)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	4.801.794	(668.991)	30. Apr. 2021	(683.413)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	2.029.716	(605.710)	24. Mai. 2023	(613.800)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	4.794.738	(507.518)	24. Okt. 2022	(505.326)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	3.036.142	28.669	24. Jul. 2023	30.738
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	3.004.968	(534.771)	26. Apr. 2023	(489.212)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	5.695.175	(1.314.911)	10. Mai. 2023	(1.602.788)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	3.964.810	(164.680)	19. Jun. 2023	(259.429)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	2.974.603	(575.826)	30. Sep. 2021	(601.147)
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	6.101.080	24.989	20. Sep. 2023	24.989
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Merrill Lynch	USD	3.444.970	22.451	29. Okt. 2021	22.451
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Morgan Stanley	USD	4.931.601	(283.303)	13. Jul. 2021	(294.932)
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	6.664.666	334.005	22. Aug. 2023	335.267
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	1.043.261	17.312	13. Jul. 2021	17.312
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	6.124.938	(1.022.867)	21. Jun. 2023	(1.019.450)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	GBP	4.716.290	(551.861)	8. Dez. 2020	(555.691)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	5.812.229	188.291	1. Jun. 2021	123.584
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	HKD	3.747.539	202.695	23. Dez. 2020	202.695
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	JPY	4.178.173	895.219	24. Okt. 2022	922.894
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	13.522.367	1.412.201	24. Okt. 2022	1.400.835
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	8.890.450	2.358.330	26. Apr. 2023	2.368.779
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	15.228.645	2.723.000	5. Apr. 2021	2.666.277
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	GBP	346.560	94.821	8. Dez. 2020	94.282
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	7.032.708	931.854	17. Mai. 2021	771.706
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	7.694.970	1.894.317	20. Sep. 2021	1.591.564
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	2.447.781	(317.609)	8. Dez. 2020	(320.232)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	7.249.662	(1.370.903)	23. Nov. 2020	(1.095.386)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.394.036	(586.031)	23. Sep. 2021	(586.031)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	7.173.174	302.890	1. Jul. 2021	38.460
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	EUR	6.297.548	2.343.486	21. Jun. 2022	2.292.858
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	5.214.743	(549.500)	26. Apr. 2023	(566.308)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	3.604.790	(755.513)	26. Apr. 2023	(859.913)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	4.101.333	25.680	4. Okt. 2023	25.680
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1.713.134	347.319	15. Jul. 2021	347.254
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	CAD	1.951.916	(696.383)	31. Mai. 2021	(722.266)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	1.520.775	(135.604)	2. Aug. 2023	(137.007)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	2.030.837	(117.406)	26. Apr. 2023	(117.948)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	2.056.185	177.709	29. Jun. 2021	(65.831)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	2.610.224	154.319	31. März. 2021	(76.283)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	PLN	2.537.077	(308.435)	13. Jul. 2022	(301.359)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	12.309.354	458.701	26. Apr. 2023	457.321
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	4.168.757	258.270	30. Aug. 2023	258.270
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	3.047.202	(2.633)	2. Okt. 2023	(2.633)
Verkauf Short	Telekommunikation	Merrill Lynch	USD	8.492.512	423.976	30. Sep. 2021	426.853
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	HKD	3.596.587	(1.224.829)	23. Dez. 2020	(1.585.768)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	ZAR	1.656.840	(357.928)	27. Jan. 2022	(406.223)
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	2.260.536	(864.098)	30. Nov. 2020	(878.645)
Verkauf Short	Diverse*	Goldman Sachs	USD	3.491.948	(485.056)	1. Mai. 2023	(487.127)
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	30.059.722	(571.817)	17. Mai 2021	(402.169)
EUR							13.959.928
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	EUR	26.461.729	345.723	5. Okt. 2020	345.723
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	EUR	2.566.657	6.829	4. Jun. 2021	6.829
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	JPY	40.419.356	(1.264.046)	5. Okt. 2020	(1.264.046)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	JPY	2.838.541	(40.011)	4. Jun. 2021	(40.011)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	159.151.428	4.734.397	5. Okt. 2020	4.734.397
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	17.210.944	269.340	4. Jun. 2021	269.340
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	11.961.365	(172.015)	4. Okt. 2021	(172.015)
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	EUR	42.603.703	931.828	5. Okt. 2020	931.828
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	JPY	75.874.297	295.670	5. Okt. 2020	295.670
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	129.183.071	2.093.218	5. Okt. 2020	2.093.218
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	2.212.733	25.033	4. Jun. 2021	25.033
USD							7.225.966
Schroder GAIA Sirius US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	15.797.310	(1.335.962)	14. Feb. 2022	(1.347.289)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	19.962.358	(429.174)	12. März. 2022	(433.025)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	34.441.159	(508)	12. Mai 2022	(7.025)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	12.753.200	46.840	14. Feb. 2022	46.840
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.758.814	(240.984)	20. Mai 2021	(240.984)
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Goldman Sachs	USD	8.520.994	868.664	15. Nov. 2021	871.612
Verkauf Short	Bekleidung	Credit Suisse	USD	1.356.454	(65.860)	12. Mai 2021	(65.860)
Verkauf Short	Banken	Credit Suisse	USD	4.526.440	275.936	12. Mai 2021	275.936
Verkauf Short	Biotechnologie	Credit Suisse	USD	2.070.304	160.765	12. Mai 2021	160.765
Verkauf Short	Biotechnologie	Merrill Lynch	USD	2.381.699	(109.323)	24. Mai 2021	(116.694)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	999.846	974	2. März. 2021	974
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.847.984	144.941	26. März. 2021	144.941
Verkauf Short	Computer	Credit Suisse	USD	4.763.419	(408.807)	12. Mai 2021	(408.807)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	866.571	(43.972)	2. März. 2021	(43.972)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Credit Suisse	USD	753.846	(49.764)	12. Mai 2021	(49.764)
Verkauf Short	Elektronik	Credit Suisse	USD	1.073.980	(42.013)	12. Mai 2021	(42.013)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	1.598.674	143.793	23. Nov. 2020	143.793
Verkauf Short	Unterhaltung	Merrill Lynch	USD	1.814.495	485.194	30. Jul. 2021	485.194
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	4.181.776	133.702	12. Aug. 2021	133.702
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1.090.214	(38.457)	15. Nov. 2021	(38.457)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	6.158.799	781.399	22. Feb. 2021	781.568
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	1.078.822	23.849	30. Apr. 2021	23.849

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Merrill Lynch	USD	1.367.085	(137.799)	28. Jun. 2021	(137.799)
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	15.181.078	66.694	3. Nov. 2020	66.694
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	16.845.593	279.809	10. März. 2021	279.809
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	78.724.000	1.658.169	26. März. 2021	1.658.169
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	8.490.761	70.692	14. Apr. 2021	70.692
Verkauf Short	Internet	Credit Suisse	USD	2.361.712	(308.113)	12. Mai 2021	(308.113)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	5.109.301	220.895	15. Nov. 2021	220.895
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	1.852.773	276.241	14. Feb. 2022	276.241
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	1.616.061	57.639	12. Mai 2022	59.238
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Credit Suisse	USD	818.704	116.544	12. Mai 2021	116.544
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	1.797.227	(148.322)	15. Nov. 2021	(148.322)
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Credit Suisse	USD	1.477.761	147.297	12. Mai 2021	147.297
Verkauf Short	Öl u. Gas	Credit Suisse	USD	1.613.265	368.974	12. Mai 2021	368.974
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	1.498.449	(11.978)	12. Mai 2022	(11.600)
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Merrill Lynch	USD	1.661.421	102.561	8. März. 2021	102.561
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	2.717.766	(116.725)	25. Okt. 2021	(116.235)
Verkauf Short	REITS	Credit Suisse	USD	2.788.808	196.928	12. Mai. 2021	192.640
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	1.611.518	(116.063)	15. Nov. 2021	(116.063)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	1.995.185	71.081	12. Mai 2022	71.291
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	2.534.017	194.924	6. Okt. 2020	194.924
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1.342.390	(11.224)	28. Dez. 2020	(11.224)
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	314.628	14.357	19. Apr. 2021	14.357
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	402.433	203.408	24. Mai 2021	203.408
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1.885.188	257.986	1. Jun. 2021	257.986
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1.028.090	235.895	2. März. 2021	235.895
Verkauf Short	Einzelhandel	Barclays Bank	USD	901.600	11.331	15. Okt. 2020	-
Verkauf Short	Einzelhandel	Credit Suisse	USD	1.435.584	(234.361)	12. Mai 2021	(234.361)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.601.155	(97.492)	13. Nov. 2020	(97.492)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	3.480.689	(460.730)	15. Nov. 2021	(460.730)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	696.685	159.217	28. Dez. 2020	159.217
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1.440.085	131.366	12. März. 2021	131.366
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1.888.798	(418.107)	24. Mai 2021	(418.107)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	2.599.351	(239.188)	26. Jul. 2021	(239.188)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	2.107.637	297.821	26. März. 2021	297.821
Verkauf Short	Halbleiter	Credit Suisse	USD	2.309.442	7.285	12. Mai 2021	13.868
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	1.765.413	(43.003)	12. Mai 2022	(43.003)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	3.099.039	(90.574)	26. März. 2021	(90.574)
Verkauf Short	Telekommunikation	Credit Suisse	USD	2.503.932	131.243	12. Mai 2021	143.444
Verkauf Short	Transport	Credit Suisse	USD	1.687.044	(96.886)	12. Mai 2021	(96.886)
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	1.040.442	73.761	19. Apr. 2021	73.761
USD							3.102.679
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	1.249.645.738	(3.847.192)	21. Okt. 2020	(3.847.192)
USD							(3.847.192)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	429.653	12.801	24. Mai 2023	12.801
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	USD	146.972	(63)	24. Mai 2023	(63)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	11.076	913	9. Mai 2023	913
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	148.988	(4.537)	15. Mai 2023	(4.537)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	255.151	(5.268)	15. Mai 2023	(5.268)
Kauf Long	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	84.033	2.893	24. Mai 2023	2.893
Kauf Long	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	265.933	(3.554)	9. Mai 2023	(3.554)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	EUR	96.989	2.121	24. Mai 2023	2.121
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	AUD	21.343	468	24. Mai 2023	468
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	CHF	280.924	2.848	24. Mai 2023	2.848
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.737.610	(44.919)	24. Mai 2023	(44.919)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	GBP	770.763	37.889	24. Mai 2023	37.889
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	19.071	(668)	24. Mai 2023	(668)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	NOK	348.390	1.628	24. Mai 2023	1.628
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	SEK	133.513	3.443	24. Mai 2023	3.443
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	3.508.890	(4.477)	24. Mai 2023	(4.477)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	CZK	249.795	10.961	9. Mai 2023	10.961
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	188.309	(22.518)	22. Jun. 2022	(22.518)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	45.368	(3.438)	22. Jun. 2022	(3.438)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	NOK	112.543	(8.089)	22. Jun. 2022	(8.089)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	SEK	368.761	(18.401)	22. Aug. 2022	(18.401)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	107.806	(5.881)	22. Jun. 2021	(5.881)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	4.899	(87)	5. Mai 2023	(87)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	1.749.980	(61.253)	9. Mai 2023	(61.253)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	ZAR	257.196	35.679	9. Mai 2023	35.679
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	652.791	(11.074)	15. Mai 2023	(11.074)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	182.361	(22.995)	15. Mai 2023	(22.995)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	MXN	252.897	(377)	17. Sep. 2030	(377)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	3.651.892	(150.606)	15. Mai 2023	(150.606)
Kauf Long	Getränke	Goldman Sachs	USD	1.317.879	20.128	24. Mai 2023	20.128
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	229.512	(12.115)	24. Mai 2023	(12.115)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	202.870	27.378	24. Mai 2023	27.378
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	7.073.194	308.218	24. Mai 2023	308.218
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	92.582	4.837	22. Jun. 2021	4.837
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.337.129	(51.368)	9. Mai 2023	(51.368)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	411.868	(3.342)	15. Mai 2023	(3.342)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	4.439.670	288.976	15. Mai 2023	288.976
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	EUR	403.267	(4.192)	22. Jun. 2022	(4.192)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	394.415	3.134	24. Mai 2023	3.134
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	3.307.927	89.557	24. Mai 2023	89.557
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	802.795	(52.678)	22. Jun. 2022	(52.678)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	688.198	(81.260)	9. Mai 2023	(81.260)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.229.138	74.834	22. Jun. 2021	74.834
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.111.382	109.008	9. Mai 2023	109.008
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.171.332	64.092	15. Mai 2023	64.092
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	593.559	15.215	24. Mai 2023	15.215
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	7.817	1.169	25. Mai 2023	1.169
Kauf Long	Computer	J.P. Morgan	USD	491.258	14.758	9. Mai 2023	14.758
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	GBP	105.452	(7.769)	15. Mai 2023	(7.769)
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	196.126	(2.701)	15. Mai 2023	(2.701)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	USD	372.034	9.171	24. Mai 2023	9.171
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	AUD	3.506	(67)	24. Mai 2023	(67)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	CAD	18.306	(562)	25. Mai 2023	(562)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	318.285	3.995	24. Mai 2023	3.995
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	275.342	39.935	24. Mai 2023	39.935
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.802.606	35.581	24. Mai 2023	35.581
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	10.342	(1.349)	22. Jun. 2021	(1.349)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.226.022	(24.353)	9. Mai 2023	(24.353)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	833.948	4.738	15. Mai 2023	4.738
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	142.508	6.531	15. Mai 2023	6.531
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	682.307	(448)	15. Mai 2023	(448)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	710	12	24. Mai 2023	12
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	8.402	(414)	9. Mai 2023	(414)
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	EUR	9.699	481	24. Mai 2023	481
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	EUR	572.414	2.967	22. Jun. 2022	2.967
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	404.576	17.222	24. Mai 2023	17.222
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	1.921.277	84.880	9. Mai 2023	84.880
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	334.739	(4.293)	15. Mai 2023	(4.293)
Kauf Long	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	320.789	(29.443)	15. Mai 2023	(29.443)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	161.754	1.193	24. Mai 2023	1.193
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	432.257	11.811	24. Mai 2023	11.811
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	140.882	(9.008)	9. Mai 2023	(9.008)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	277.197	(4.675)	15. Mai 2023	(4.675)
Kauf Long	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	413.475	40.585	24. Mai 2023	40.585
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	142.629	6.339	15. Mai 2023	6.339
Kauf Long	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	1.077.389	81.124	24. Mai 2023	81.124
Kauf Long	Gas	J.P. Morgan	EUR	110.050	(6.785)	9. Mai 2023	(6.785)
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	EUR	405.023	(44.977)	15. Mai 2023	(44.977)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	CHF	54.902	2.005	24. Mai 2023	2.005
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	EUR	631.403	23.327	24. Mai 2023	23.327
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	GBP	193.725	7.822	24. Mai 2023	7.822
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	HKD	34.833	(1.699)	24. Mai 2023	(1.699)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	8.319.972	273.242	24. Mai 2023	273.242
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	EUR	5.673	15	22. Jun. 2022	15
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	4.261.463	40.691	22. Jun. 2021	40.691
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	2.613.672	(81.229)	9. Mai 2023	(81.229)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	CHF	370.645	19.807	15. Mai 2023	19.807
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	EUR	121.643	557	15. Mai 2023	557
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	GBP	263.829	(10.125)	15. Mai 2023	(10.125)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	232.241	(16.589)	15. Mai 2023	(16.589)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	2.647.585	(13.740)	15. Mai 2023	(13.740)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	395.738	9.941	24. Mai 2023	9.941
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	4.560.930	203.316	24. Mai 2023	203.316
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	428.383	7.427	22. Jun. 2021	7.427
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.229.487	103.538	9. Mai 2023	103.538
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.571.205	55.321	15. Mai 2023	55.321
Kauf Long	Holdinggesellschaften - Diverse	Goldman Sachs	USD	287.200	(27.834)	24. Mai 2023	(27.834)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Holdinggesellschaften - Diverse	J.P. Morgan	USD	477.490	(24.317)	9. Mai 2023	(24.317)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	667.649	44.983	24. Mai 2023	44.983
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	J.P. Morgan	USD	620.815	41.144	9. Mai 2023	41.144
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	302.104	20.100	15. Mai 2023	20.100
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	AUD	495.863	20.168	24. Mai 2023	20.168
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	CAD	599.958	4.201	25. Mai 2023	4.201
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	30.034	(531)	24. Mai 2023	(531)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	190.268	(26.974)	24. Mai 2023	(26.974)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	HKD	157.605	(4.831)	24. Mai 2023	(4.831)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	4.339.530	131.543	24. Mai 2023	131.543
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	431.335	5.215	9. Mai 2023	5.215
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	23.291	(574)	9. Mai 2023	(574)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	183.744	(15.234)	15. Mai 2023	(15.234)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	GBP	97.008	(25.196)	15. Mai 2023	(25.196)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	806.535	(36.200)	15. Mai 2023	(36.200)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	EUR	704.026	(23.989)	24. Mai 2023	(23.989)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	1.619.518	57.103	24. Mai 2023	57.103
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	143.111	12.699	22. Jun. 2022	12.699
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	596.235	50.183	9. Mai 2023	50.183
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	265.976	(9.042)	15. Mai 2023	(9.042)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	1.405.696	(44.410)	15. Mai 2023	(44.410)
Kauf Long	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	USD	13.144	75	24. Mai 2023	75
Kauf Long	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	USD	429.918	33.123	9. Mai 2023	33.123
Kauf Long	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	419.210	(3.568)	15. Mai 2023	(3.568)
Kauf Long	Freizeit	Goldman Sachs	USD	319.495	23.525	24. Mai 2023	23.525
Kauf Long	Freizeit	Morgan Stanley	USD	204.824	33.055	15. Mai 2023	33.055
Kauf Long	Maschinen - Bau u. Bergbau	J.P. Morgan	USD	478.333	(7.525)	9. Mai 2023	(7.525)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	673.098	(16.233)	24. Mai 2023	(16.233)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	365.554	11.984	22. Jun. 2021	11.984
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	311.985	(10.569)	9. Mai 2023	(10.569)
Kauf Long	Medien	J.P. Morgan	USD	681.800	31.821	9. Mai 2023	31.821
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	40.466	116	15. Mai 2023	116
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	USD	1.313.078	80.549	24. Mai 2023	80.549
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	J.P. Morgan	USD	169.869	(15.371)	9. Mai 2023	(15.371)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	141.753	(9.949)	24. Mai 2023	(9.949)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	USD	523.812	2.496	24. Mai 2023	2.496
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	ZAR	124.500	(21.227)	9. Mai 2023	(21.227)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	USD	767.474	(48.111)	15. Mai 2023	(48.111)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	SEK	295.808	(4.657)	24. Mai 2023	(4.657)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	1.031.349	2.681	24. Mai 2023	2.681
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	273.163	11.896	22. Jun. 2021	11.896
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	40.803	(2.715)	15. Mai 2023	(2.715)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	12.663	(479)	24. Mai 2023	(479)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	506.281	(68.783)	9. Mai 2023	(68.783)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	1.557.118	(236.616)	9. Mai 2023	(236.616)
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	577.782	(43.743)	15. Mai 2023	(43.743)
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	177.732	(16.725)	24. Mai 2023	(16.725)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	1.217.988	(37.136)	24. Mai 2023	(37.136)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1.060.658	16.290	24. Mai 2023	16.290
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	3.340.350	(54.505)	24. Mai 2023	(54.505)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	5.172.822	(25.483)	24. Mai 2023	(25.483)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	4.425.697	(66.711)	24. Mai 2023	(66.711)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	11.974	(36)	9. Mai 2023	(36)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	14.869	(340)	9. Mai 2023	(340)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	427.829	9.060	7. Mai 2023	9.060
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	9.661	169	9. Mai 2023	169
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	2.219.260	55.600	22. Jun. 2021	55.600
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	4.820.191	(34.250)	9. Mai 2023	(34.250)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	CHF	223.347	(10.210)	15. Mai 2023	(10.210)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	163.519	436	15. Mai 2023	436
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	320.669	(6.881)	15. Mai 2023	(6.881)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	278.178	6.700	15. Mai 2023	6.700
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	3.441.833	(11.550)	15. Mai 2023	(11.550)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	2.462.335	(244.248)	9. Mai 2023	(244.248)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	1.508.740	(108.149)	15. Mai 2023	(108.149)
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	GBP	581.188	14.684	24. Mai 2023	14.684
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	934.380	12.058	9. Mai 2023	12.058
Kauf Long	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	602.306	(29.670)	22. Jun. 2022	(28.737)
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	HKD	649.759	(43.025)	15. Mai 2023	(43.025)
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	USD	4.311	(571)	15. Mai 2023	(571)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	GBP	13.374	(184)	24. Mai 2023	(184)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	240.247	758	24. Mai 2023	758
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	1.987.298	(43.818)	9. Mai 2023	(43.818)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	111.039	(9.270)	15. Mai 2023	(9.270)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	2.720.870	53.818	24. Mai 2023	53.818
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	403.441	(5.376)	22. Jun. 2021	(5.376)
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	935.694	25.892	9. Mai 2023	25.892
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	783.813	(9.145)	15. Mai 2023	(9.145)
Kauf Long	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	230.047	6.306	24. Mai 2023	6.306
Kauf Long	Spar- und Darlehensgeschäft	J.P. Morgan	USD	65.557	259	9. Mai 2023	259
Kauf Long	Spar- und Darlehensgeschäft	Morgan Stanley	USD	85.246	(6.462)	15. Mai 2023	(6.462)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	49.915	700	24. Mai 2023	700
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	385.136	7.104	9. Mai 2023	7.104
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	HKD	187.738	1.440	15. Mai 2023	1.440
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	289.950	1.275	15. Mai 2023	1.275
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	412.646	14.285	16. Sep. 2030	14.285
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	1.208.893	36.832	24. Mai 2023	36.832
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	1.560.235	78.736	9. Mai 2023	78.736
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	806.903	14.869	15. Mai 2023	14.869
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	HKD	640.299	(54.520)	24. Mai 2023	(54.520)
Kauf Long	Spielzeug/Spiele/Freizeit	Goldman Sachs	JPY	837.724	49.751	24. Mai 2023	49.751
Kauf Long	Transport	Goldman Sachs	USD	234.554	(23.951)	25. Mai 2023	(23.951)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	507.800	(44.282)	15. Mai 2023	(44.282)
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	27.342.892	384.423	27. März. 2023	384.423
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	EUR	5.112	(59)	24. Mai 2023	(59)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	GBP	6.434	(233)	24. Mai 2023	(233)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	1.094.342	(67.288)	24. Mai 2023	(67.288)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	GBP	153.620	(10.973)	9. Mai 2023	(10.973)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	GBP	1.153	21	15. Mai 2023	21
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	HKD	233.506	16.525	15. Mai 2023	16.525
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	561.780	(11.940)	24. Mai 2023	(11.940)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	535.885	23.649	15. Mai 2023	23.649
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	AUD	359.258	(5.424)	24. Mai 2023	(5.424)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CAD	789.028	13.274	25. Mai 2023	13.274
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	DKK	394.363	(4.558)	24. Mai 2023	(4.558)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.521.338	24.656	24. Mai 2023	24.656
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	HKD	640.058	16.930	24. Mai 2023	16.930
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	824.219	23.650	24. Mai 2023	23.650
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	237.358	(3.026)	24. Mai 2023	(3.026)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	939.371	(12.862)	24. Mai 2023	(12.862)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SGD	569.952	3.367	24. Mai 2023	3.367
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	6.200.311	(74.285)	24. Mai 2023	(74.285)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	627.126	32.535	22. Jun. 2022	32.535
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	461.965	62.439	9. Mai 2023	62.439
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	107.298	22.847	9. Mai 2023	22.847
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	HKD	233.725	12.414	9. Mai 2023	12.414
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	HUF	399.198	(17.816)	9. Mai 2023	(17.816)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	60.672	5.093	9. Mai 2023	5.093
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	411.136	27.546	22. Jun. 2022	27.546
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	2.690.721	117.029	9. Mai 2023	117.029
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	71.915	2.986	15. Mai 2023	2.986
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	514.422	55.156	15. Mai 2023	55.156
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	GBP	419.727	88.612	15. Mai 2023	88.612
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	HKD	40.895	2.617	15. Mai 2023	2.617
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	476.529	32.755	15. Mai 2023	32.755
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	MXN	607.226	9.873	17. Sep. 2030	9.873
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	994.695	55.449	15. Mai 2023	54.499
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	GBP	455.036	(798)	24. Mai 2023	(798)
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	GBP	171.173	(15.678)	20. Jul. 2022	(15.678)
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	293	6	22. Jun. 2022	6
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	4.301	308	15. Mai 2023	308
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	2.465.116	59.676	24. Mai 2023	59.676
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	164.224	(686)	9. Mai 2023	(686)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.042.852	(135.638)	9. Mai 2023	(135.638)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	221.263	(9.382)	15. Mai 2023	(9.382)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	493.781	34.303	15. Mai 2023	34.303
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	EUR	193.242	4.345	24. Mai 2023	4.345
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	82.668	5.084	24. Mai 2023	5.084
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	EUR	393.973	21.862	15. Mai 2023	21.862
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	671.659	(9.109)	24. Mai 2023	(9.109)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	348.760	13.099	24. Mai 2023	13.099
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	HKD	171.410	(3.165)	24. Mai 2023	(3.165)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	773.691	(8.838)	24. Mai 2023	(8.838)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	356.238	(20.990)	9. Mai 2023	(20.990)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	236.790	12.469	15. Mai 2023	12.469
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	108.506	2.619	16. Sep. 2030	2.619
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	163.365	(12.585)	15. Mai 2023	(12.585)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	406.926	(4.805)	24. Mai 2023	(4.805)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	207.401	4.577	15. Mai 2023	4.577
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	USD	218.014	(10.931)	24. Mai 2023	(10.931)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	USD	309.125	(3.191)	22. Jun. 2021	(3.191)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	362.083	1.753	24. Mai 2023	1.753
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	1.860.545	20.805	24. Mai 2023	20.805
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.189.160	(28.678)	24. Mai 2023	(28.678)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	52.493	4.387	22. Jun. 2022	4.387
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	473.659	(30.524)	22. Jun. 2021	(30.524)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	434.200	(7.659)	9. Mai 2023	(7.659)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	539.420	29.662	15. Mai 2023	29.662
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.507.412	6.045	15. Mai 2023	6.045
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	DKK	317.964	(7.672)	24. Mai 2023	(7.672)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	HKD	4.304	(60)	24. Mai 2023	(60)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	54.224	442	9. Mai 2023	442
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1.549.100	(14.010)	9. Mai 2023	(14.010)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	HKD	120.442	(1.073)	15. Mai 2023	(1.073)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	151.036	963	15. Mai 2023	963
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	182.263	(623)	24. Mai 2023	(623)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	USD	164.344	(931)	9. Mai 2023	(931)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	653.686	(40.133)	24. Mai 2023	(40.133)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	942.004	(113.535)	22. Jun. 2021	(113.535)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	459.572	(10.918)	15. Mai 2023	(10.918)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	GBP	133.752	(5.842)	24. Mai 2023	(5.842)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	SEK	25.338	(2.098)	24. Mai 2023	(2.098)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	78.561	(22.015)	24. Mai 2023	(22.015)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	137.203	(1.144)	9. Mai 2023	(1.144)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	14.792	(5.718)	9. Mai 2023	(5.863)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	43.834	(408)	15. Mai 2023	(408)
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	249.768	(6.593)	24. Mai 2023	(6.593)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	325.600	12.779	22. Jun. 2022	12.779
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	HKD	45.171	1.495	15. Mai 2023	1.495
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	CHF	494.792	(51.612)	24. Mai 2023	(51.612)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	914.973	(54.271)	24. Mai 2023	(54.271)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	JPY	370.213	1.235	24. Mai 2023	1.235
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	920.718	(810)	24. Mai 2023	(810)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	3.250.173	(187.227)	24. Mai 2023	(187.227)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	JPY	432.213	14.473	22. Aug. 2022	14.473
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	SEK	496.614	22.470	9. Mai 2023	22.470
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	2.222.592	(94.120)	22. Jun. 2021	(94.120)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	3.865.618	(559.618)	9. Mai 2023	(559.618)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	AUD	896.361	(18.886)	15. Mai 2023	(18.886)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	CHF	245.650	(14.738)	15. Mai 2023	(14.738)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	DKK	847.868	1.053	15. Mai 2023	1.053
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	JPY	216.101	6.529	15. Mai 2023	6.529

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	SEK	277.022	16.808	15. Mai 2023	16.808
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	625.099	(64.229)	15. Mai 2023	(64.229)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	652.159	(20.706)	24. Mai 2023	(20.706)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	JPY	423.592	(18.240)	24. Mai 2023	(18.240)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.885.519	10.338	24. Mai 2023	10.338
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	403.371	11.401	22. Jun. 2022	11.401
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	568.684	(40.352)	20. Jul. 2022	(40.352)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	10.798	(140)	9. Mai 2023	(140)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	489.260	(3.741)	22. Jun. 2021	(3.741)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	480.128	(25.756)	9. Mai 2023	(25.756)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	132.298	3.561	15. Mai 2023	3.561
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	995.387	(105.449)	15. Mai 2023	(105.449)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	431.142	20.108	15. Mai 2023	20.108
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	86.054	(3.907)	24. Mai 2023	(3.907)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	J.P. Morgan	USD	308.692	(6.080)	22. Jun. 2021	(6.080)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	EUR	1.661.322	(17.193)	24. Mai 2023	(17.193)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	HKD	380.029	6.700	24. Mai 2023	6.700
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	364.073	3.808	28. Sep. 2021	3.808
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	811.952	(29.340)	15. Mai 2023	(29.340)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	13.806.303	(85.909)	24. Mai 2023	(85.909)
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	HKD	7.738	(60)	5. Mai 2023	(60)
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	HKD	124.904	4.478	9. Mai 2023	4.478
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	3.585.000	95.150	20. Nov. 2020	95.150
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	11.471.079	308.161	9. Mai 2023	308.399
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	EUR	871.086	35.926	15. Mai 2023	35.926
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	31.092.676	304.245	15. Mai 2023	331.417
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	220.324	2.360	17. Mai 2023	2.360
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	1.913.719	7.545	24. Mai 2023	7.545
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	832.810	(33.512)	16. Sep. 2030	(33.512)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	1.080.174	(49.095)	24. Mai 2023	(49.095)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	460.996	(18.984)	24. Mai 2023	(18.984)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	JPY	329.941	12.336	24. Mai 2023	12.336
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	2.374.395	(77.979)	24. Mai 2023	(77.979)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	34.640	1.626	9. Mai 2023	1.626
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	89.508	7.637	9. Mai 2023	7.637
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	2.225.775	(229.669)	9. Mai 2023	(229.669)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	176.986	4.691	15. Mai 2023	4.691
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	40.248	2.651	15. Mai 2023	2.651
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	701.030	19.562	15. Mai 2023	19.562
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	579.343	(14.835)	24. Mai 2023	(14.835)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	891.336	48.474	22. Jun. 2021	48.474
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	400.741	(6.677)	9. Mai 2023	(6.677)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	GBP	155.621	1.252	15. Mai 2023	1.252
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1.960.741	18.526	15. Mai 2023	18.526
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	USD	1.197.171	2.286	24. Mai 2023	2.286
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	USD	293.455	296	9. Mai 2023	296
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	USD	469.695	43.620	15. Mai 2023	43.620
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	HKD	1.341.103	31.372	24. Mai 2023	31.372
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	135.524	(21.871)	15. Mai 2023	(21.871)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	USD	315.293	(7.794)	24. Mai 2023	(7.794)
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	USD	51.811	(8.802)	24. Mai 2023	(8.802)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	1.054.746	4.485	24. Mai 2023	4.485
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	209.001	14.319	22. Jun. 2021	14.319
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	518.310	(10.045)	9. Mai 2023	(10.045)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	103.023	5.621	15. Mai 2023	5.621
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	AUD	148.710	6.537	24. Mai 2023	6.537
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	204.117	8.487	24. Mai 2023	8.487
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	920.823	69.462	24. Mai 2023	69.462
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	1.002.418	167.443	9. Mai 2023	167.443
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	11.665.204	1.078.938	9. Mai 2023	1.078.938
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	AUD	704.595	27.649	15. Mai 2023	27.649
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	82.705	9.735	17. Mai 2023	9.735
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	-	(6)	10. Okt. 2020	(6)
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.111.725	298.541	9. Mai 2023	298.541
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CAD	163.976	5.473	25. Mai 2023	5.473
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	15.912	908	24. Mai 2023	908
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	1.288.510	(13.051)	24. Mai 2023	(13.051)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	2.301.314	(1.592)	24. Mai 2023	(1.592)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	15.503	(128)	24. Mai 2023	(128)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	813.914	8.591	24. Mai 2023	8.591
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	2.983.395	(2.171)	24. Mai 2023	(2.171)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	52.313	(717)	25. Mai 2023	(717)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	324.897	(2.863)	9. Mai 2023	(2.863)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	239.223	(22.093)	22. Jun. 2022	(22.093)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	358.990	8.191	9. Mai 2023	8.191
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	2.466.453	66.933	22. Jun. 2021	66.933
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.762.917	79.994	9. Mai 2023	79.994
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	CAD	4.751	231	15. Mai 2023	231
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	192.545	(5.103)	15. Mai 2023	(5.103)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	153.591	5.523	15. Mai 2023	5.523
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	2.081.625	14.668	15. Mai 2023	14.668
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.311.736	103.328	15. Mai 2023	103.328
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	437.258	24.317	24. Mai 2023	24.317
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	2.271.697	170.773	9. Mai 2023	170.773
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	1.172.822	(8.802)	24. Mai 2023	(8.802)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	HKD	86.041	3.288	24. Mai 2023	3.288
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	347.864	(3.894)	24. Mai 2023	(3.894)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	HKD	816	45	9. Mai 2023	45
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	10.860	150	22. Jun. 2021	150
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	HKD	90.626	6.414	15. Mai 2023	6.414
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	USD	84.073	4.506	15. Mai 2023	4.506
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	489.887	(37.415)	24. Mai 2023	(37.415)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	1.839.361	8.042	24. Mai 2023	8.042
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	211.952	(8.153)	9. Mai 2023	(8.153)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	679.926	75.219	9. Mai 2023	75.219
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	EUR	179.447	14.106	15. Mai 2023	14.106
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	355.284	18.456	15. Mai 2023	18.456
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	458.213	1.178	24. Mai 2023	1.178
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	JPY	296.849	3.021	24. Mai 2023	3.021

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.573.711	92.731	24. Mai 2023	92.731
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	EUR	233.726	(2.661)	9. Mai 2023	(2.661)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	696.146	(28.959)	9. Mai 2023	(28.959)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	JPY	32.722	619	15. Mai 2023	619
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	136.078	(11.429)	15. Mai 2023	(11.429)
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	50.850	405	24. Mai 2023	405
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	411.034	(1.006)	24. Mai 2023	(1.006)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	284.131	(11.491)	24. Mai 2023	(11.491)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	438.576	(27.992)	22. Jun. 2021	(27.992)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	514.642	11.232	9. Mai 2023	11.232
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	425.419	(3.739)	15. Mai 2023	(3.739)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	512.530	20.584	24. Mai 2023	20.584
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	EUR	192.444	(2.590)	24. Mai 2023	(2.590)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	121.627	6.257	24. Mai 2023	6.257
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	1.544.190	(11.835)	24. Mai 2023	(11.835)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	AUD	447.601	10.189	7. Mai 2021	10.189
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	CHF	315.884	41.105	22. Jun. 2022	41.105
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	EUR	509.850	15.042	20. Jul. 2022	15.042
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1.059.203	(11.073)	9. Mai 2023	(11.073)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	CHF	510.864	60.546	15. Mai 2023	60.546
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	EUR	340.834	6.293	15. Mai 2023	6.293
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	1.396.070	(42.527)	15. Mai 2023	(42.527)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	748.579	(848)	24. Mai 2023	(848)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	200.720	3.061	9. Mai 2023	3.061
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	206.329	6.149	15. Mai 2023	6.149
Verkauf Short	Wasser	J.P. Morgan	USD	94.370	(7.922)	9. Mai 2023	(7.922)
USD							2.865.277

Differenzkontrakte

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

Zum 30. September 2020 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Credit Suisse	(17)	(8.548)	(870)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Credit Suisse	(380)	(36.837)	4.018
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Credit Suisse	533	252.316	(6.403)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Credit Suisse	257	315.822	(808)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Credit Suisse	651	347.263	(7.832)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Credit Suisse	479	299.638	(10.727)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Credit Suisse	(507)	(399.714)	(2.790)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Credit Suisse	350	367.381	(6.083)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Credit Suisse	516	334.478	(2.222)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Credit Suisse	(799)	(220.042)	(753)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Credit Suisse	(467)	(133.034)	(4.022)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Credit Suisse	(9)	(1.981)	208
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Credit Suisse	665	675.873	21.215
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Credit Suisse	1.359	571.554	16.157
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Credit Suisse	576	384.824	(9.070)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Credit Suisse	(346)	(78.667)	4.233
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Credit Suisse	(409)	(83.534)	(3.111)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Credit Suisse	729	295.629	107
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	421	508.439	(15.416)
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	1.350	889.844	(16.721)
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	(12)	(2.730)	464
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	(638)	(255.381)	(3.382)
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	742	913.417	(21.413)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	810	527.050	(6.303)
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	247	507.477	(19.522)
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	1.299	519.619	5.617
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	1.132	341.708	(2.462)
		USD	6.831.864	(87.891)
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf argentinische Aktien	Morgan Stanley	(37.183)	(94.398)	(94.398)
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(100.835)	(121.317)	(121.317)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	(206.778)	5.342	5.342
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(1.133.083)	10.452	10.638
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	(165.500)	65.134	65.134
CFD auf chinesische Aktien	Morgan Stanley	35.580	(148.010)	(148.010)
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	38.066	(190)	(190)
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	379.001	3.086.720	3.086.720
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	(50.000)	52.297	52.297
CFD auf Aktien aus Hongkong	Morgan Stanley	(15.700)	15.133	15.133
CFD auf irische Aktien	Morgan Stanley	(12.935)	59.778	59.778
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(49.339)	(227.750)	(227.750)
CFD auf israelische Aktien	Morgan Stanley	(16.077)	48.752	48.752
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(1.076.128)	309.804	309.804
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	86.672	(38.268)	(38.268)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1.626.263)	(1.379.005)	(1.379.005)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.840.516)	602.077	604.064
		USD	2.246.551	2.248.724
Schroder GAIA Helix				
CFD auf argentinische Aktien	Goldman Sachs	336	2.017	2.017
CFD auf argentinische Aktien	J.P. Morgan	4.411	57.344	57.344
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	2.149.614	(44.656)	(44.724)
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	77.824	33.557	33.557
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	31.959	145.451	145.451
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	(11.273)	(14.330)	(14.330)
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	22.168	(76.118)	(76.118)
CFD auf belgische Aktien	J.P. Morgan	(9.986)	99.180	99.180
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	9.804.874	826.048	830.307
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	3.333.834	(231.547)	(231.720)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	765.059	14.661	14.661
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	26.840	57.321	57.321
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	18.379.858	(602.258)	(607.273)
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	6.883.945	(88.706)	(88.706)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	1.225	7.799	7.785
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	(21.064)	52.516	52.516
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	288.284	(40.634)	(40.634)
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	171.318	50.537	50.537
CFD auf ägyptische Aktien	J.P. Morgan	(98.278)	13.949	13.949
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	323.695	(126.003)	(126.003)
CFD auf finnische Aktien	J.P. Morgan	(32.061)	76.245	76.245
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	145.481	(512.073)	(512.123)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	374.061	(457.655)	(457.655)
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	265.293	(143.595)	(143.595)
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	130.588	(287.582)	(287.582)
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	5.241.006	(149.684)	(151.635)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	1.232.000	(269.189)	(269.189)
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	94.909	96.726	96.726
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	75.407	73.145	73.145
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	525	37.186	37.186
CFD auf irische Aktien	J.P. Morgan	(9.727)	23.964	23.964
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	171.400	(38.510)	(38.536)
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	884.589	(57.822)	(57.822)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	2.322.577	(522.662)	(494.537)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	4.542.263	(35.663)	(35.663)
CFD auf luxemburgische Aktien	J.P. Morgan	204.144	(85.478)	(85.478)
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	678.400	(268.658)	(269.341)
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	217.000	(162.399)	(162.399)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	(22.689)	32.693	38.459
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	443.232	19.150	19.150
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	208.300	25.433	25.433
CFD auf polnische Aktien	J.P. Morgan	(8.574)	38.530	38.530
CFD auf portugiesische Aktien	Goldman Sachs	(45.997)	8.207	8.207
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	24.484	(22.965)	(22.965)
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	4.444.342	10.707	10.707
CFD auf russische Aktien	J.P. Morgan	14.491	106.253	106.253
CFD auf saudi-arabische Aktien	Goldman Sachs	(106.153)	12.965	12.965
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	41.765	(15.301)	(15.301)
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	240.509	(46.242)	(66.611)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	431.400	(25.112)	(25.112)
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	547.895	(2.140)	(2.140)
CFD auf südafrikanische Aktien	J.P. Morgan	(10.754)	14.320	14.320
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	(72.764)	195.317	195.288
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	38.292	(18.406)	(18.406)
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	641.178	325.202	325.202
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	174.356	(211.598)	(211.598)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	47.720	(53.098)	(51.416)
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	235.428	(239.271)	(239.271)
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	3.816	(276)	(276)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(206.056)	(2.839)	(2.839)
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	Goldman Sachs	(29.315)	(14.072)	(14.072)
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	J.P. Morgan	89.678	(5.823)	(5.823)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	822.848	(172.881)	(176.174)
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	814.068	(195.708)	(195.708)
CFD auf FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(190)	(113.189)	(113.189)
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(13.453)	595.657	595.657
CFD auf MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(2.010)	416.169	418.692
		USD	(1.885.894)	(1.875.210)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	3.549.996	190.482	190.482
CFD auf irische Aktien	Morgan Stanley	(22.980)	(25.498)	(25.498)
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	Morgan Stanley	(76.838)	(28.584)	(28.584)
CFD auf FTSE 250 Index	Bank of America	(476)	(220.714)	(220.714)
		GBP	(84.314)	(84.314)

Credit Default Index

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

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

Am 30. September 2020 waren die folgenden Teilfonds Credit Default Index-Kontrakte auf Finanzindizes eingegangen:

Schutzposition	beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 34 20/12/2025	J.P. Morgan	EUR	3.000.000	5,00	20. Dez. 2025	256.059
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 34 20/12/2025	J.P. Morgan	EUR	28.000.000	1,00	20. Dez. 2025	708.915
Verkauf	CDX North America High Yield Series 35 20/12/2025	J.P. Morgan	USD	1.000.000	5,00	20. Dez. 2025	(2.432)
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 35 20/12/2025	J.P. Morgan	USD	28.000.000	1,00	20. Dez. 2025	554.735
						USD	1.517.277
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 34 20/12/2025	Citi Bank	EUR	20.000.000	1,00	20. Dez. 2025	12.318
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 34 20/12/2025	Citi Bank	EUR	40.000.000	1,00	20. Dez. 2025	(94.357)
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 35 20/12/2025	Citi Bank	USD	80.000.000	1,00	20. Dez. 2025	207.739
						USD	125.700
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX North America High Yield Series 32 20/06/2024	Morgan Stanley	USD	2.670.000	5,00	20. Jun. 2024	67.394
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 34 20/06/2025	Morgan Stanley	USD	71.025.000	1,00	20. Jun. 2025	(248.020)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Credit Default Index (Forts.)

Schutzposition	beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	CDX Emerging Markets Series 34 20/12/2025	Morgan Stanley	USD	5.330.000	1,00	20. Dez. 2025	(6.242)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 34 20/12/2025	Morgan Stanley	EUR	27.136.000	1,00	20. Dez. 2025	9.448
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 34 20/12/2025	Morgan Stanley	EUR	15.125.000	1,00	20. Dez. 2025	3.867
							USD (173.553)

Credit Default Swaps

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

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

Zum 30. September 2020 war der folgende Teilfonds in Credit Default Swap-Vereinbarungen engagiert:

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	Australien	Bergbau	Morgan Stanley	EUR	825.000	20. Dez. 2025	13.329
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	4.075.000	20. Dez. 2025	386
Verkauf	Brazil	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	810.000	20. Dez. 2024	46.149
Verkauf	Brazil	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	909.000	20. Jun. 2025	(13.916)
Verkauf	Brazil	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.380.000	20. Dez. 2025	37.063
Verkauf	Chile	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	169.000	20. Jun. 2025	(1.407)
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	375.000	20. Jun. 2025	(3.054)
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	600.000	20. Dez. 2025	2.548
Verkauf	Kolumbien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.642.000	20. Jun. 2025	(14.020)
Verkauf	Kolumbien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.707.000	20. Dez. 2025	14.194
Verkauf	Frankreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	825.000	20. Dez. 2025	9.343
Verkauf	Frankreich	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	EUR	1.125.000	20. Dez. 2024	26.640
Verkauf	Frankreich	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	3.725.000	20. Dez. 2025	8.814
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	3.725.000	20. Dez. 2025	1.572
Verkauf	Frankreich	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	EUR	4.440.000	20. Dez. 2025	15.167
Verkauf	Frankreich	REITS	Morgan Stanley	EUR	1.925.000	20. Jun. 2025	(18.527)
Verkauf	Indonesien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	781.000	20. Dez. 2025	1.533
Kauf	Italy	Banken	Barclays Bank	EUR	1.525.000	20. Dez. 2025	6.806
Kauf	Luxemburg	Medien	Barclays Bank	EUR	525.000	20. Dez. 2024	44.646
Verkauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Barclays Bank	USD	422.000	20. Dez. 2024	1.106
Verkauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Barclays Bank	USD	330.000	20. Jun. 2025	(1.010)
Verkauf	Mexico	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	730.000	20. Dez. 2024	7.046
Verkauf	Mexico	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	13.609.210	20. Dez. 2025	116.500
Verkauf	Peru	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.915.000	20. Jun. 2025	6.550
Verkauf	Philippinen	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	758.000	20. Jun. 2025	3.692

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Credit Default Swaps (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	Russische Föderation	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	385.000	20. Dez. 2024	2.367
Verkauf	Saudi-Arabien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	776.000	20. Dez. 2025	249
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.506.000	20. Jun. 2025	(27.130)
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	EUR	1.425.000	20. Dez. 2025	14.464
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	6.776.000	20. Dez. 2025	32.043
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	3.244.000	20. Dez. 2024	(2.622)
Verkauf	Schweiz	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	EUR	2.350.000	20. Dez. 2025	14.771
Verkauf	Türkei	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	464.000	20. Jun. 2025	(3.088)
Verkauf	Türkei	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	400.000	20. Dez. 2025	2.763
Kauf	Türkei	Öffentliche Hand	Goldman Sachs	USD	490.000	20. Jun. 2026	27.312
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.075.000	20. Jun. 2023	33.852
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	3.550.000	20. Dez. 2025	733
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	5.775.000	20. Dez. 2025	(4.483)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	BNP Paribas	EUR	2.175.000	20. Dez. 2025	(10.224)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	2.325.000	20. Dez. 2025	(2.368)
Kauf	Vereinigte Staaten	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500.000	20. Dez. 2024	77.873
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910.000	20. Jun. 2025	(24.514)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	995.000	20. Dez. 2024	171.584
Verkauf	Vereinigte Staaten	Medien	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20. Dez. 2024	(17.625)
Kauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	Goldman Sachs	USD	700.000	20. Dez. 2020	(13.245)
Kauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705.000	20. Jun. 2024	(31.853)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	3.720.000	20. Jun. 2025	(30.752)
USD							521.257

Cross-Currency Swap-Kontrakte

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

Zum 30. September 2020 war der folgende Teilfonds in Cross-Currency Swap-Kontrakten engagiert:

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeits-	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Bank of America	RUB	124.950.000	USD	1.797.842	15. Jun. 2025	5,05 %	USD LIBOR 3 Months	166.386
Bank of America	USD	1.200.000	MXN	26.040.000	4. Dez. 2030	USD LIBOR 1 Month	MXN TIIE 28 Days	1.558
Bank of America	USD	6.496.705	RUB	449.572.000	16. Dez. 2022	USD LIBOR 3 Months	4,07 %	(738.303)
Bank of America	USD	1.173.161	RUB	81.652.000	16. Dez. 2025	USD LIBOR 3 Months	4,17 %	(135.514)
Barclays	TRY	8.749.000	USD	1.453.926	15. Jun. 2025	10,93 %	USD LIBOR 3 Months	362.494
BNP Paribas	USD	18.103.243	RUB	1.367.700.000	16. Dez. 2021	USD LIBOR 3 Months	4,30 %	(504.570)
BNP Paribas	ZAR	17.775.000	USD	1.050.532	17. Dez. 2030	ZAR JIBAR 3 Months	USD LIBOR 3 Months	4.773
Citi Bank	USD	1.008.844	RUB	76.884.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	4,38 %	(23.256)
Citi Bank	USD	3.161.077	RUB	240.716.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	4,35 %	(80.039)
Goldman Sachs	USD	3.274.909	RUB	224.757.000	16. Dez. 2022	USD LIBOR 3 Months	3,95 %	(407.691)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Cross-Currency Swap-Kontrakte (Forts.)

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeits-	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)								
Goldman Sachs	USD	3.123.200	RUB	237.738.000	17. März. 2023	USD LIBOR 3 Months	4,35 %	(69.563)
J.P. Morgan	RUB	22.099.000	USD	344.597	15. Dez. 2024	6,04 %	USD LIBOR 3 Months	48.856
J.P. Morgan	RUB	75.162.000	USD	1.071.218	21. Dez. 2025	4,09 %	USD LIBOR 3 Months	113.391
J.P. Morgan	TRY	3.172.000	USD	455.682	16. Dez. 2022	16,15 %	USD LIBOR 3 Months	37.250
J.P. Morgan	TRY	10.595.000	USD	1.509.259	16. Dez. 2022	17,27 %	USD LIBOR 3 Months	86.901
J.P. Morgan	TRY	4.200.000	USD	580.111	16. Dez. 2022	17,70 %	USD LIBOR 3 Months	12.447
J.P. Morgan	TRY	8.281.000	USD	1.110.054	17. März. 2023	15,36 %	USD LIBOR 3 Months	25.670
J.P. Morgan	TRY	11.365.000	USD	1.475.016	17. März. 2023	16,31 %	USD LIBOR 3 Months	(35.380)
J.P. Morgan	TRY	11.033.000	USD	1.942.601	15. Dez. 2024	13,73 %	USD LIBOR 3 Months	497.586
J.P. Morgan	USD	5.534.301	GBP	4.334.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	GBP LIBOR 3 Months	59.656
J.P. Morgan	USD	1.196.416	MXN	26.040.000	4. Dez. 2030	USD LIBOR 1 Month	MXN TIIE 28 Days	5.170
Morgan Stanley	USD	8.432.352	AUD	11.489.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	AUD BBR 6 Months	(181.553)
Morgan Stanley	USD	8.462.362	CAD	11.062.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	CAD BA 3 Months	(147.951)
Morgan Stanley	USD	5.061.976	EUR	4.311.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	EUR EURIBOR 3 Months	(9.319)
Morgan Stanley	USD	6.618.772	GBP	5.218.000	16. Dez. 2025	USD LIBOR 3 Months	GBP LIBOR 3 Months	97.080
Morgan Stanley	USD	1.406.966	GBP	1.053.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	GBP LIBOR 3 Months	(46.500)
Morgan Stanley	USD	8.446.691	NOK	74.042.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	NOK NIBOR 3 Months	(517.917)
Morgan Stanley	USD	8.471.483	NZD	12.529.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	NZD BBR 3 Months	(178.808)
Morgan Stanley	USD	8.464.993	SEK	73.408.000	17. März. 2026	USD LIBOR 3 Months	SEK STIBOR 3 Months	(274.559)
USD								(1.831.705)

Zins-Swaps

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

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

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Zum 30. September 2020 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 4,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	200.000.000	MXN	14. Dez. 2022	43.860
Zahlt Festzinssatz 8,48 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	11.594.490	BRL	4. Jan. 2021	(188.231)
Erhält Festzinssatz 10,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	11.594.490	BRL	4. Jan. 2021	279.138
Zahlt Festzinssatz 11,86 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	55.361.483	BRL	4. Jan. 2021	(2.468.631)
Erhält Festzinssatz 9,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	55.361.483	BRL	4. Jan. 2021	1.630.071
Erhält Festzinssatz 4,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	200.000.000	MXN	14. Dez. 2022	(5.736)
Erhält Festzinssatz 6,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	200.000.000	MXN	15. Jun. 2022	309.380
Zahlt Festzinssatz 6,26 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	200.000.000	MXN	15. Jun. 2022	(265.944)
Erhält Festzinssatz -0,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	1.000.000	CHF	16. Dez. 2030	(1.143)
Erhält Festzinssatz 0,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	100.000.000	JPY	16. Dez. 2040	(7.536)
Erhält Festzinssatz 0,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	250.000.000	SEK	16. Dez. 2022	25.318
Erhält Festzinssatz 0,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	2.715.655	NZD	16. Dez. 2022	9.940
Zahlt Festzinssatz -0,01 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	2.715.655	NZD	16. Dez. 2022	1.309
Erhält Festzinssatz 0,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	15.000.000	USD	16. Dez. 2024	(27.099)
Erhält Festzinssatz -0,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	2.000.000	CHF	16. Dez. 2030	13.402
Erhält Festzinssatz -0,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	1.000.000	CHF	16. Dez. 2030	6.701
Erhält Festzinssatz 0,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	SEK	16. Dez. 2030	26.213
Erhält Festzinssatz 0,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	5.000.000	USD	16. Dez. 2022	(1.700)
Erhält Festzinssatz 0,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	30.000.000	USD	16. Dez. 2022	(10.203)
Erhält Festzinssatz -0,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	40.000.000	EUR	16. Dez. 2022	71.347
Erhält Festzinssatz -0,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	30.000.000	EUR	16. Dez. 2022	53.511
Zahlt Festzinssatz 0,41 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	95.966.851	JPY	16. Dez. 2040	(28.740)
Erhält Festzinssatz 0,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	295.966.851	JPY	16. Dez. 2040	(113.173)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,20 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	530.450	USD	16. Dez. 2045	(10.197)
Erhält Festzinssatz -0,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	8.000.000	CHF	16. Dez. 2025	(8.084)
Erhält Festzinssatz 0,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	530.450	USD	16. Dez. 2045	(48.213)
Erhält Festzinssatz 0,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	67.000.000	SEK	16. Dez. 2025	16.358
Zahlt Festzinssatz 1,12 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	725.013	USD	16. Dez. 2040	(6.778)
Erhält Festzinssatz 0,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	33.000.000	SEK	16. Dez. 2025	8.057
Erhält Festzinssatz 0,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	725.013	USD	16. Dez. 2040	(46.125)
Erhält Festzinssatz 0,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	8.000.000	USD	16. Dez. 2027	(33.480)
Zahlt Festzinssatz 5,23 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	139.743.590	MXN	10. Dez. 2025	(19.252)
Erhält Festzinssatz 4,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	139.743.590	MXN	10. Dez. 2025	(90.717)
				USD	(886.377)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 1,33 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	281.258.000	KRW	18. Jun. 2030	(2.685)
Zahlt Festzinssatz 6,08 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	19.239.000	ZAR	16. Jun. 2022	(27.546)
Zahlt Festzinssatz 1,02 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.372.377.000	KRW	18. Jun. 2030	3.602
Erhält Festzinssatz 4,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	1.022.879.000	CLP	18. Jun. 2030	35.983
Zahlt Festzinssatz 10,97 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	22.845.000	ZAR	6. März. 2030	(182.533)
Zahlt Festzinssatz 0,08 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	19.373.000	NZD	15. Sep. 2022	(13.047)
Zahlt Festzinssatz 1,12 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.514.755.000	KRW	17. Sep. 2030	(1.287)
Erhält Festzinssatz 3,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	J.P. Morgan	730.098.000	INR	16. Dez. 2022	(24.267)
Erhält Festzinssatz 0,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.563.000	USD	16. Dez. 2022	3.859
Erhält Festzinssatz 4,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	116.400.000	ZAR	16. Dez. 2022	76.384
Zahlt Festzinssatz 4,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	411.223.000	MXN	15. Dez. 2021	7.817
Erhält Festzinssatz 2,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	8.625.065.000	COP	16. Dez. 2022	27.703

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Wahrung	Falligkeitsda- tum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhalt Festzinssatz 2,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	8.625.065.000	COP	16. Dez. 2022	23.029
Erhalt Festzinssatz 3,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	4.797.995.000	COP	16. Dez. 2025	18.566
Zahlt Festzinssatz 2,43 %					
Erhalt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Bank of America	7.460.000	CNY	16. Dez. 2025	12.539
Zahlt Festzinssatz 6,80 %					
Erhalt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6.940.000	MXN	11. Dez. 2030	1.976
Zahlt Festzinssatz 6,07 %					
Erhalt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	3.972.653.000	COP	17. Dez. 2030	(12.173)
Erhalt Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	1.751.999.000	COP	16. Dez. 2025	5.112
Erhalt Festzinssatz 3,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.503.999.000	COP	16. Dez. 2025	10.750
Erhalt Festzinssatz 3,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	1.747.723.000	COP	16. Dez. 2025	3.276
Zahlt Festzinssatz 0,42 %					
Erhalt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.443.000	AUD	16. Dez. 2025	(4.119)
Erhalt Festzinssatz 1,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.576.000	NZD	17. Dez. 2030	5.651
Erhalt Festzinssatz 0,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	161.718.000	GBP	15. Sep. 2022	75.618
Zahlt Festzinssatz 9,44 %					
Erhalt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	2.889.099	BRL	2. Jan. 2025	(65.139)
Zahlt Festzinssatz 6,71 %					
Erhalt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	3.571.494	BRL	2. Jan. 2025	18.327
Erhalt Festzinssatz 6,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	2.846.638	BRL	2. Jan. 2025	9.321
Erhalt Festzinssatz 5,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	3.993.016	BRL	2. Jan. 2025	1.082
Erhalt Festzinssatz 6,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	1.265.348	BRL	2. Jan. 2025	2.950
Erhalt Festzinssatz 5,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	3.983.068	BRL	2. Jan. 2025	(4.612)
Erhalt Festzinssatz 5,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.300.103	BRL	2. Jan. 2025	(9.995)
Erhalt Festzinssatz 3,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10.921.653	BRL	3. Jan. 2022	29.780
Erhalt Festzinssatz 3,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	3.997.933	BRL	3. Jan. 2022	2.659
Erhalt Festzinssatz 5,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Citi Bank	8.424.319	BRL	2. Jan. 2025	(20.491)
Erhalt Festzinssatz 5,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	4.267.863	BRL	2. Jan. 2025	(10.559)
Erhalt Festzinssatz 4,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	164.494.000	INR	16. Dez. 2025	(22.792)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Citi Bank	11.862.031	BRL	2. Jan. 2025	(105.263)
Erhält Festzinssatz 5,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Citi Bank	6.840.959	BRL	2. Jan. 2025	(28.883)
Zahlt Festzinssatz 5,95 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	J.P. Morgan	2.061.395.000	COP	17. Dez. 2030	(4.027)
Erhält Festzinssatz 5,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Citi Bank	6.868.235	BRL	2. Jan. 2025	(34.460)
Zahlt Festzinssatz 0,76 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	935.000	USD	16. Dez. 2030	(3.025)
Zahlt Festzinssatz 0,17 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.235.000	NZD	16. Dez. 2025	(1.465)
Erhält Festzinssatz 0,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.256.000	PLN	16. März. 2023	2.014
Erhält Festzinssatz 1,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.141.845.000	HUF	16. Dez. 2025	(23.657)
Erhält Festzinssatz -0,10 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	59.389.000	GBP	15. Dez. 2022	(203.883)
Erhält Festzinssatz -0,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	145.704.000	EUR	21. Dez. 2023	(216.316)
Zahlt Festzinssatz 0,22 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.490.000	USD	16. Dez. 2022	(3.145)
Erhält Festzinssatz 2,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	5.634.803.000	COP	17. März. 2023	11.118
Erhält Festzinssatz 5,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	6.346.798	BRL	2. Jan. 2025	(30.270)
Erhält Festzinssatz 2,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	31.148.015.000	COP	16. Dez. 2022	51.415
Zahlt Festzinssatz 3,43 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	10.172.795.000	COP	16. Dez. 2025	(24.689)
Erhält Festzinssatz 0,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	9.114.820.000	CLP	16. Dez. 2022	1.383
Erhält Festzinssatz 2,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	5.767.819.000	COP	16. Dez. 2022	8.018
Zahlt Festzinssatz 4,45 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	825.565.000	COP	16. Dez. 2030	(2.063)
Zahlt Festzinssatz 4,44 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	1.533.680.000	COP	16. Dez. 2030	(3.495)
Erhält Festzinssatz 4,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	99.285.000	MXN	21. Sep. 2023	(11.368)
Zahlt Festzinssatz 1,11 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.812.875.000	KRW	18. März. 2031	14
Erhält Festzinssatz 7,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14.935.000	MXN	7. Jun. 2028	89.104
Zahlt Festzinssatz 0,91 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	2.657.103.000	KRW	16. Dez. 2025	(591)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,87 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.889.000	PLN	18. Dez. 2029	(14.526)
Erhält Festzinssatz 0,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	141.118.000	JPY	18. Dez. 2029	(2.774)
Erhält Festzinssatz 6,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.755.000	MXN	19. Sep. 2029	66.003
Zahlt Festzinssatz 1,77 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	552.000	PLN	19. März. 2030	(3.292)
Zahlt Festzinssatz 1,77 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.815.000	PLN	19. März. 2030	(28.866)
Zahlt Festzinssatz -0,13 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	364.414.000	JPY	15. Dez. 2024	6.109
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.536.000	PLN	19. März. 2030	(29.419)
Erhält Festzinssatz 1,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.513.000	AUD	19. März. 2030	26.805
Erhält Festzinssatz 0,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	98.727.000	SEK	16. Jun. 2022	31.572
Zahlt Festzinssatz 0,69 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	10.041.000	AUD	16. Jun. 2022	(45.102)
Erhält Festzinssatz 0,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.605.000	GBP	16. Jun. 2022	33.588
Zahlt Festzinssatz 6,32 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Citi Bank	959.725.000	ZAR	25. Jan. 2021	(432.214)
Erhält Festzinssatz 6,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Citi Bank	990.220.000	ZAR	24. Jan. 2022	413.807
Zahlt Festzinssatz 1,67 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	174.408.000	NOK	16. Jun. 2022	(241.163)
Erhält Festzinssatz 1,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	530.000	AUD	18. Jun. 2030	3.735
Zahlt Festzinssatz 0,66 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.257.000	GBP	15. Jun. 2025	(49.290)
Zahlt Festzinssatz 0,98 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.510.000	CZK	18. Jun. 2030	437
Erhält Festzinssatz 0,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	14.381.000	SGD	16. Jun. 2022	48.668
Erhält Festzinssatz 0,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	14.380.000	SGD	16. Jun. 2022	61.576
Zahlt Festzinssatz 0,39 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.140.000	SEK	18. Jun. 2030	3.217
Erhält Festzinssatz 1,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	2.304.000	CAD	15. Jun. 2025	11.047
Zahlt Festzinssatz 10,09 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	24.475.000	ZAR	6. März. 2030	(130.543)
Zahlt Festzinssatz 5,52 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.135.000	MXN	17. Apr. 2025	(56.176)
Zahlt Festzinssatz 0,34 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	14.644.000	SEK	21. Sep. 2025	(10.672)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 5,64 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	19.800.000	MXN	23. Apr. 2025	(23.855)
Zahlt Festzinssatz 5,44 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	46.770.000	MXN	1. Mai 2025	(38.385)
Erhält Festzinssatz 1,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	334.000	AUD	17. Sep. 2030	1.643
Zahlt Festzinssatz 5,24 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	97.760.000	MXN	16. Mai 2025	(42.188)
Zahlt Festzinssatz 1,09 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.665.000	PLN	17. Sep. 2030	8.502
Erhält Festzinssatz 5,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	45.660.000	MXN	5. Jun. 2023	20.042
Erhält Festzinssatz 0,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18.354.000	NOK	16. Dez. 2022	5.153
Zahlt Festzinssatz 0,25 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	30.779.000	SEK	16. Dez. 2025	(34.220)
Erhält Festzinssatz 0,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	108.189.000	SEK	15. Dez. 2022	20.590
Zahlt Festzinssatz 0,78 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	23.974.000	SEK	17. Dez. 2030	(36.088)
Erhält Festzinssatz 0,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.840.000	GBP	16. Dez. 2025	10.119
Zahlt Festzinssatz 0,53 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	930.000	GBP	16. Dez. 2030	(7.946)
Erhält Festzinssatz 0,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.705.000	GBP	15. Dez. 2022	3.354
Erhält Festzinssatz 0,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	41.843.000	NOK	16. Dez. 2025	28.284
Erhält Festzinssatz -0,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.121.000	EUR	16. Dez. 2022	15.472
Zahlt Festzinssatz -0,22 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.826.000	EUR	16. Dez. 2025	(56.443)
Erhält Festzinssatz 1,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.554.000	AUD	16. Dez. 2030	27.467
Zahlt Festzinssatz 7,12 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	40.036.000	MXN	11. Sep. 2030	(11.496)
Erhält Festzinssatz 0,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	12.311.000	NZD	16. Dez. 2022	39.675
Erhält Festzinssatz 0,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.863.000	NZD	16. Dez. 2030	49.117
Erhält Festzinssatz 0,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	4.117.000	SGD	16. Dez. 2022	10.791
Erhält Festzinssatz 2,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	31.481.000	MYR	16. Dez. 2022	32.868
Zahlt Festzinssatz 2,36 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.038.000	MYR	16. Dez. 2025	(2.963)
Erhält Festzinssatz 0,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.060.660.000	HUF	16. Dez. 2021	(30.676)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 0,99 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	692.294.000	HUF	16. Dez. 2025	43.032
Erhält Festzinssatz 0,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	16.495.220.000	KRW	16. Dez. 2022	8.852
Erhält Festzinssatz 3,82 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	241.516.000	ZAR	16. Dez. 2021	65.284
Zahlt Festzinssatz 4,62 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	56.055.000	ZAR	15. Dez. 2022	(19.990)
Erhält Festzinssatz 5,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	114.900.000	ZAR	16. Dez. 2025	183.753
Erhält Festzinssatz 0,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.011.000	PLN	15. Dez. 2022	1.185
Erhält Festzinssatz 0,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	68.425.000	PLN	16. Dez. 2022	64.482
Erhält Festzinssatz 0,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.955.000	PLN	16. Dez. 2025	14.361
Erhält Festzinssatz 0,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	7.185.000	PLN	16. Dez. 2021	1.982
Zahlt Festzinssatz 0,15 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	BNP Paribas	66.391.000	ILS	15. Dez. 2022	(1.063)
Erhält Festzinssatz 0,10 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	21.553.000	ILS	16. Dez. 2022	(479)
Zahlt Festzinssatz 0,35 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Bank of America	5.254.000	ILS	16. Dez. 2025	(5.401)
Erhält Festzinssatz 0,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	335.071.000	CZK	16. Dez. 2022	19.171
Erhält Festzinssatz 4,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	366.264.000	MXN	14. Dez. 2022	(7.812)
Erhält Festzinssatz 5,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	240.828.000	MXN	10. Dez. 2025	36.823
Zahlt Festzinssatz 1,13 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.001.000	USD	17. Sep. 2030	3.138
Zahlt Festzinssatz 0,44 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.077.000	USD	16. Dez. 2025	(2.921)
Erhält Festzinssatz 0,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.672.000	USD	16. Dez. 2030	(8.863)
Zahlt Festzinssatz 0,25 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	26.245.000	USD	15. Dez. 2022	(6.445)
Erhält Festzinssatz 0,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	9.100.000	CAD	16. Dez. 2025	8.660
Erhält Festzinssatz 0,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	18.815.000	CAD	15. Sep. 2022	11.493
Erhält Festzinssatz 1,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	414.000	AUD	17. Sep. 2030	2.150
Erhält Festzinssatz 0,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	40.047.000	PLN	15. Dez. 2022	18.726

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz -0,09 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	727.000	EUR	16. Dez. 2030	(9.420)
Zahlt Festzinssatz 0,16 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	34.508.000	SEK	16. Dez. 2025	(17.230)
Zahlt Festzinssatz 0,31 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	6.189.000	ILS	16. Dez. 2025	(2.592)
Erhält Festzinssatz 5,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	J.P. Morgan	76.400.000	RUB	16. Dez. 2025	(12.853)
Erhält Festzinssatz 0,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	4.163.000	SGD	16. Dez. 2022	6.639
Zahlt Festzinssatz 0,50 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	5.265.000	AUD	16. Dez. 2025	(31.286)
Zahlt Festzinssatz 0,72 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.635.000	USD	16. Dez. 2030	(1.895)
Zahlt Festzinssatz 0,42 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.113.000	NZD	16. Dez. 2025	(10.390)
Zahlt Festzinssatz 0,42 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.177.000	NZD	16. Dez. 2025	(39.338)
Erhält Festzinssatz 0,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	18.528.000	PLN	15. Dez. 2022	7.465
Erhält Festzinssatz 4,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	100.705.000	MXN	14. Dez. 2022	(8.778)
Zahlt Festzinssatz 0,53 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.244.000	GBP	17. Dez. 2030	9.911
Erhält Festzinssatz 5,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	52.740.000	MXN	17. Jun. 2030	(24.168)
Zahlt Festzinssatz 7,18 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.285.000	ZAR	16. Dez. 2030	1.183
Zahlt Festzinssatz 0,67 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	605.102.000	HUF	15. Dez. 2022	10.344
Zahlt Festzinssatz 0,66 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	235.256.000	HUF	15. Dez. 2022	4.126
Zahlt Festzinssatz 0,25 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	11.434.000	ILS	16. Dez. 2025	4.663
Erhält Festzinssatz 2,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	164.609.000	HUF	17. Dez. 2030	(932)
Zahlt Festzinssatz 1,41 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	J.P. Morgan	431.756.000	CLP	16. Dez. 2025	(942)
Zahlt Festzinssatz 1,89 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Citi Bank	5.854.000	MYR	16. Dez. 2025	23.383
Erhält Festzinssatz 4,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	86.287.000	ZAR	16. Dez. 2022	33.098
Erhält Festzinssatz 1,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.642.000	NOK	17. Dez. 2030	1.759
Erhält Festzinssatz 5,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24.800.000	MXN	8. Jul. 2030	(14.577)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.916.577.000	CLP	17. Dez. 2030	549
Zahlt Festzinssatz 1,23 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.247.000	PLN	17. Dez. 2030	7.460
Erhält Festzinssatz 0,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	915.000	GBP	16. Dez. 2025	2.853
Zahlt Festzinssatz 0,37 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.266.000	NZD	16. Dez. 2025	(9.856)
Erhält Festzinssatz 1,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.641.000	NOK	17. Dez. 2030	(1.289)
Erhält Festzinssatz 1,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.645.000	NOK	17. Dez. 2030	(356)
Erhält Festzinssatz 0,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	17.400.000	USD	16. Dez. 2025	2.212
Erhält Festzinssatz 0,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.308.000	NZD	21. Dez. 2025	20.152
Zahlt Festzinssatz 0,32 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	7.736.000	SEK	16. Dez. 2030	(607)
Erhält Festzinssatz 4,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	15.015.000	MXN	14. Dez. 2022	(3.368)
Erhält Festzinssatz 0,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.444.000	PLN	16. Dez. 2025	3.640
Erhält Festzinssatz 0,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	125.442.000	CZK	16. Dez. 2022	7.620
Erhält Festzinssatz 0,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.652.000	PLN	16. Dez. 2025	3.525
Zahlt Festzinssatz 4,91 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	130.060.000	MXN	29. Jul. 2025	38.837
Zahlt Festzinssatz 4,84 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	44.515.000	MXN	28. Jul. 2025	19.417
Erhält Festzinssatz 5,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	37.600.000	MXN	23. Jul. 2030	(28.640)
Erhält Festzinssatz 5,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	12.530.000	MXN	22. Jul. 2030	(12.623)
Zahlt Festzinssatz -0,03 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.084.000	EUR	17. Dez. 2030	(5.038)
Erhält Festzinssatz 5,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.890.000	MXN	29. Jul. 2030	(14.990)
Erhält Festzinssatz 2,08 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	543.793.000	HUF	17. Dez. 2030	(3.709)
Erhält Festzinssatz 2,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	705.136.000	HUF	17. Dez. 2030	(5.831)
Zahlt Festzinssatz 6,73 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	30.107.000	MXN	11. Dez. 2030	11.861
Zahlt Festzinssatz 6,79 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	80.311.000	MXN	11. Dez. 2030	23.475
Zahlt Festzinssatz 1,36 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.193.000	PLN	17. Dez. 2030	686

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 0,90 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	2.445.693.000	KRW	16. Dez. 2025	732
Zahlt Festzinssatz 4,91 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	88.795.000	MXN	11. Aug. 2025	27.388
Erhält Festzinssatz 5,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	25.505.000	MXN	5. Aug. 2030	(24.426)
Zahlt Festzinssatz 6,59 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	48.333.000	MXN	11. Dez. 2030	28.653
Zahlt Festzinssatz 1,05 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	2.051.546.000	KRW	17. Dez. 2030	4.370
Zahlt Festzinssatz 7,29 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11.429.000	ZAR	16. Dez. 2030	(4.611)
Erhält Festzinssatz 4,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	70.690.000	MXN	18. Aug. 2023	(664)
Zahlt Festzinssatz 0,41 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.596.000	AUD	16. Dez. 2025	(4.055)
Zahlt Festzinssatz 5,10 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	66.735.000	MXN	19. Aug. 2025	(3.348)
Zahlt Festzinssatz 0,18 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.381.000	NZD	16. Dez. 2025	(5.807)
Erhält Festzinssatz 0,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.149.500	NOK	16. Dez. 2025	4.380
Erhält Festzinssatz 0,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.038.500	NOK	16. Dez. 2025	5.653
Erhält Festzinssatz 0,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.182.000	USD	16. Dez. 2030	(7.800)
Zahlt Festzinssatz 4,42 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	213.920.000	MXN	1. Sep. 2021	3.210
Zahlt Festzinssatz 4,43 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	116.500.000	MXN	30. Aug. 2021	1.296
Zahlt Festzinssatz 5,08 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	133.700.000	MXN	27. Aug. 2025	(2.088)
Zahlt Festzinssatz 5,09 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	133.705.000	MXN	25. Aug. 2025	(3.713)
Erhält Festzinssatz 5,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	25.690.000	MXN	21. Aug. 2030	(3.633)
Erhält Festzinssatz 5,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	25.690.000	MXN	19. Aug. 2030	(3.123)
Zahlt Festzinssatz 1,64 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.941.000	PLN	17. Dez. 2030	(15.783)
Zahlt Festzinssatz 4,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	126.160.000	MXN	30. Aug. 2021	367
Erhält Festzinssatz 4,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	144.215.000	MXN	28. Aug. 2023	3.705
Erhält Festzinssatz 1,46 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.822.000	AUD	17. Dez. 2030	9.153

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	790.375.000	CLP	16. Dez. 2030	(8.400)
Erhält Festzinssatz 2,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	790.375.000	CLP	16. Dez. 2030	(3.286)
Zahlt Festzinssatz 0,75 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	935.000	USD	16. Dez. 2030	(2.289)
Erhält Festzinssatz 3,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	86.780.000	ZAR	16. Dez. 2022	22.000
Zahlt Festzinssatz 0,75 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	2.645.924.000	CLP	16. Dez. 2022	(5.416)
Zahlt Festzinssatz 1,24 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	2.017.758.000	KRW	17. Dez. 2030	(10.875)
Zahlt Festzinssatz 1,02 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	881.941.000	HUF	16. Dez. 2022	8.935
Zahlt Festzinssatz 1,85 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	188.552.000	HUF	16. Dez. 2030	(6.031)
Erhält Festzinssatz 1,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	719.105.000	HUF	16. Dez. 2025	1.036
Zahlt Festzinssatz 1,47 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	J.P. Morgan	720.935.000	CLP	16. Dez. 2025	(4.334)
Zahlt Festzinssatz 0,55 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	587.810.000	CZK	16. Dez. 2022	(62.687)
Zahlt Festzinssatz 0,71 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.740.000	USD	16. Dez. 2030	1.558
Erhält Festzinssatz 0,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.405.000	USD	16. Dez. 2025	(53)
Erhält Festzinssatz 0,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	518.690.000	CZK	16. Dez. 2025	246.429
Zahlt Festzinssatz 1,04 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	144.755.000	CZK	16. Dez. 2030	(138.144)
Erhält Festzinssatz 0,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	7.810.090.000	HUF	16. Dez. 2021	(72.683)
Zahlt Festzinssatz 0,98 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.780.545.000	HUF	16. Dez. 2022	87.391
Zahlt Festzinssatz 1,73 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	21.790.000	HUF	16. Dez. 2030	90
Zahlt Festzinssatz 0,12 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	52.495.000	ILS	16. Dez. 2022	(5.107)
Erhält Festzinssatz 0,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	73.885.000	ILS	16. Dez. 2025	56.132
Zahlt Festzinssatz 0,72 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	17.485.000	ILS	16. Dez. 2030	(15.513)
Zahlt Festzinssatz 0,25 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	76.995.000	PLN	15. Dez. 2022	(14.490)
Erhält Festzinssatz 0,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	42.660.000	PLN	16. Dez. 2025	78.732

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,10 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.350.000	PLN	16. Dez. 2030	(86.569)
Erhält Festzinssatz 4,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	61.958.000	ZAR	17. März. 2023	14.037
Erhält Festzinssatz 5,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Bank of America	172.575.000	RUB	16. Dez. 2025	1.881
Zahlt Festzinssatz 4,87 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	BNP Paribas	1.385.675.000	RUB	16. Dez. 2021	2.839
Zahlt Festzinssatz 2,87 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	8.512.000	CNY	17. März. 2026	(9.902)
Zahlt Festzinssatz 1,20 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	3.694.380.000	KRW	17. Dez. 2030	(15.074)
Erhält Festzinssatz 3,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	40.506.000	ZAR	16. Dez. 2022	4.724
Erhält Festzinssatz 4,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	55.688.000	MXN	15. März. 2023	(3.582)
Erhält Festzinssatz 0,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6.923.000	CAD	17. März. 2023	4.224
Erhält Festzinssatz 1,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	853.000	CAD	17. März. 2031	2.524
Zahlt Festzinssatz 0,09 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	16.596.000	SEK	17. März. 2026	(687)
Erhält Festzinssatz 1,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.255.000	NOK	17. März. 2031	7.037
Zahlt Festzinssatz 5,22 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	196.860.000	ZAR	16. Dez. 2025	(30.203)
Erhält Festzinssatz 7,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	113.205.000	ZAR	16. Dez. 2030	(260)
Erhält Festzinssatz 10,10 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26.300.000	ZAR	17. Dez. 2030	(1.160)
Erhält Festzinssatz 0,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	6.381.955.000	CLP	16. Dez. 2022	3.256
Erhält Festzinssatz 0,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	3.191.235.000	CLP	16. Dez. 2022	1.138
Erhält Festzinssatz 0,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6.450.180.000	CLP	16. Dez. 2022	1.705
Zahlt Festzinssatz 1,48 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	7.077.405.000	CLP	16. Dez. 2025	(46.771)
Zahlt Festzinssatz 1,50 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	4.955.415.000	CLP	16. Dez. 2025	(38.191)
Zahlt Festzinssatz 1,49 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	2.477.910.000	CLP	16. Dez. 2025	(17.853)
Zahlt Festzinssatz 1,48 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7.184.445.000	CLP	16. Dez. 2025	(49.417)
Erhält Festzinssatz 2,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.662.585.000	CLP	16. Dez. 2030	7.073

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.164.100.000	CLP	16. Dez. 2030	8.444
Erhält Festzinssatz 2,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.583.645.000	CLP	16. Dez. 2030	13.027
Erhält Festzinssatz 2,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	582.095.000	CLP	16. Dez. 2030	4.257
Zahlt Festzinssatz 0,13 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.500.000	NZD	16. Dez. 2025	347
Zahlt Festzinssatz -0,47 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	17.620.000	EUR	16. Dez. 2022	(10.149)
Erhält Festzinssatz -0,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.040.000	EUR	16. Dez. 2025	23.528
Zahlt Festzinssatz -0,15 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.205.000	EUR	16. Dez. 2030	(15.736)
Zahlt Festzinssatz -0,41 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.313.000	EUR	17. März. 2026	(1.433)
Erhält Festzinssatz 2,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	BNP Paribas	83.462.000	CNY	16. Dez. 2025	57.278
Zahlt Festzinssatz 1,00 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	999.330.000	HUF	16. Dez. 2022	11.234
Zahlt Festzinssatz 7,23 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	29.455.000	ZAR	16. Dez. 2030	(3.916)
Zahlt Festzinssatz 0,06 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	61.797.000	JPY	17. März. 2031	78
Erhält Festzinssatz 0,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	2.637.262.000	KRW	16. Dez. 2022	3.492
Erhält Festzinssatz 1,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	5.463.000	ILS	17. Dez. 2030	3.085
Erhält Festzinssatz 0,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	3.028.000	AUD	15. März. 2026	870
Zahlt Festzinssatz 4,38 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	390.940.000	MXN	16. Sep. 2021	15.487
Erhält Festzinssatz 2,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	242.595.000	HUF	17. Dez. 2030	1.476
Erhält Festzinssatz 3,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	100.960.000	ZAR	17. März. 2023	(2.807)
Erhält Festzinssatz 0,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	12.145.293.000	KRW	16. März. 2023	6.978
Erhält Festzinssatz 4,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	165.173.000	ZAR	17. März. 2023	32.309
Erhält Festzinssatz 0,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.013.000	PLN	17. März. 2023	(1.260)
Zahlt Festzinssatz 0,92 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.720.000	PLN	16. Dez. 2030	3.967
Erhält Festzinssatz 0,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	13.110.000	PLN	16. Dez. 2025	(2.785)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,46 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	5.895.000	MXN	22. Sep. 2022	398
Erhält Festzinssatz 0,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.840.000	USD	15. März. 2026	(257)
Erhält Festzinssatz 3,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	59.921.000	ZAR	17. März. 2023	6.831
Zahlt Festzinssatz 4,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	305.580.000	MXN	26. Sep. 2022	22.389
Erhält Festzinssatz 4,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	102.950.000	MXN	25. Sep. 2023	(13.581)
Zahlt Festzinssatz 1,28 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.605.187.000	HUF	17. März. 2023	(3.410)
Zahlt Festzinssatz 1,27 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	770.367.000	HUF	17. März. 2023	(1.149)
Zahlt Festzinssatz 1,11 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	3.816.027.000	KRW	18. März. 2031	785
Zahlt Festzinssatz 1,27 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	603.170.000	HUF	17. März. 2023	(938)
				USD	(420.724)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2020 gestaltete sich die Exponierung bei in Bezug auf Derivatkontrakte zu erhaltenden Sicherheiten je Kontrahent folgendermaßen:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA BlueTrend				
	Credit Suisse	Barmittel	USD	465.582
	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	3.262
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	920.708
	J.P. Morgan	Barmittel	NZD	10.643
	J.P. Morgan	Barmittel	SEK	704.989
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	749.278
			USD	2.383.645
Schroder GAIA Cat Bond				
	Brown Brothers Harriman & Co	Barmittel	USD	250.000
			USD	250.000
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Barmittel	EUR	3.160.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	12.091.594
	Morgan Stanley	Barmittel	HKD	104.518
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	7
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	21.606
			EUR	15.281.531
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	1.372.213
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	487.796
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	967.140
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	5.434.346

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	751.170
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	292.016
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	616.044
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	9.297.252
			USD	18.018.898
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	1.320.000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	4.000.000
			USD	5.320.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	Citi Bank	Barmittel	EUR	2.167.059
	Credit Suisse	Barmittel	EUR	5.101.588
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	17.438.634
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	20.216.426
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	1.400.000
	Societe Generale	Barmittel	CAD	605.784
	Societe Generale	Barmittel	GBP	24.255
	Societe Generale	Barmittel	KRW	2.169.012.757
	Societe Generale	Barmittel	SEK	3.802.189
	Societe Generale	Barmittel	TRY	3
	Societe Generale	Barmittel	USD	17.478.951
	Societe Generale	Barmittel	ZAR	2.097.434
			USD	50.929.352
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
	HSBC	Barmittel	GBP	740.000
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	925.820
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
			GBP	1.665.828
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	3.550.000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	990.000
	Citi Bank	Barmittel	USD	2.914.000
	Credit Suisse	Barmittel	USD	60.000
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	90.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	1.405.838
	HSBC	Barmittel	USD	78.709
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	3.073.400
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	726.000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	19.431
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	10.722
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	552.786
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	15.856
	Morgan Stanley	Barmittel	NZD	4
	Morgan Stanley	Barmittel	SEK	6
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	8
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	494.000
			USD	14.072.500

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für das Berichtsjahr fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA BlueTrend	USD	48.042
Schroder GAIA Cat Bond	USD	56.917
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	644.829
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	1.134.033
Schroder GAIA Helix	USD	811.139
Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*	USD	20.749
Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*	USD	31.415
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	2.201.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	409.643
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	34.392
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	1.332.010

Dividenden

Während des Berichtsjahres haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüt- tung pro Anteil
11. Okt. 2019	18. Okt. 2019	25. Okt. 2019	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	453,82	USD	2,047093
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.040,95	SGD	2,730424
8. Nov. 2019	15. Nov. 2019	22. Nov. 2019	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	965,63	USD	4,355767
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.220,47	SGD	5,824042
13 Dez. 2019	20 Dez. 2019	27 Dez. 2019	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	1.256,89	USD	5,669584
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.881,27	SGD	7,556447
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch. QV	48.152,61	USD	15,550657
10. Jan. 2020	17. Jan. 2020	24. Jan. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	968,40	USD	4,368076
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.225,23	SGD	5,835126
14. Feb. 2020	21. Feb. 2020	28. Feb. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	1.087,86	USD	4,906679
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.564,13	SGD	6,723107
13. März. 2020	20. März. 2020	27. März. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	900,22	USD	4,060169
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.108,27	SGD	5,527141
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch. QV	52.376,26	USD	17,309317
14. Apr. 2020	17. Apr. 2020	24. Apr. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	1.020,45	USD	4,602429
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.929,81	SGD	6,081975
8. März. 2020	15. März. 2020	22. März. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	778,11	USD	3,509246
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.483,46	SGD	4,674673
12 Jun. 2020	19 Jun. 2020	26 Jun. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	1.099,24	USD	4,957539
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.071,93	SGD	6,528443
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch. QV	52.996,05	USD	16,975683

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2020 (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüt- tung pro Anteil
10. Jul. 2022	17. Jul. 2022	24. Jul. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	814,21	USD	3,671922
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.554,21	SGD	4,896372
14. Aug. 2020	21. Aug. 2020	28. Aug. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	874,07	USD	3,941878
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.656,87	SGD	5,219296
11. Sep. 2020	18. Sep. 2020	25. Sep. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	748,30	USD	3,374682
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.432,17	SGD	4,510909
29. Sep. 2020	30. Sep. 2020	13. Okt. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch. QV	76.345,07	USD	14,481866
			Schroder GAIA BlueTrend Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	79,61	GBP	0,263596
			Schroder GAIA BlueTrend Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	53.513,51	GBP	0,427887

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 30. September 2020 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 1,17245 US-Dollar

1 Euro = 0,90863 Pfund Sterling

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 11. Dezember 2020 wurde die folgende Anteilsklasse aufgelegt: Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert).

Gesamtkostenquote („TER“)

für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020

Anteilsklasse	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*	Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*	Schroder GAIA Sirius US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	2,38 %	1,78 %	2,45 %	2,45 %	2,44 %	2,36 %	2,38 %	2,45 %	-	-	2,45 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,47 %	-	2,49 %	-	2,46 %	2,41 %	2,41 %	2,49 %	-	-	2,48 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,41 %	-	2,48 %	-	2,46 %	2,41 %	2,41 %	2,48 %	-	-	2,48 %
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	2,48 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,40 %	-	2,52 %	-	2,46 %	2,41 %	2,41 %	-	-	-	2,48 %
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	2,48 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	2,45 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	2,96 %	2,95 %	-	-	-	-	-	-	2,95 %
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	2,99 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	1,65 %	1,38 %	1,69 %	1,70 %	1,38 %	1,65 %	1,65 %	1,70 %	1,83 %	1,39 %	1,70 %
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,73 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,69 %	1,39 %	1,72 %	-	1,41 %	1,68 %	1,68 %	1,72 %	1,86 %	1,42 %	1,73 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,69 %	1,39 %	1,72 %	-	1,41 %	1,68 %	1,68 %	1,73 %	1,86 %	1,42 %	1,73 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,69 %	1,37 %	1,72 %	1,72 %	1,41 %	1,68 %	1,68 %	1,72 %	1,86 %	-	1,73 %
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	1,73 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1,72 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	1,72 %	-	1,41 %	1,68 %	1,68 %	-	-	-	1,73 %
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	1,72 %	-	-	-	-	-	1,43 %	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	1,69 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	1,70 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,67 %	-	-	-	-	-	-	1,73 %	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	1,70 %	-	1,38 %	-	-	-	-	-	1,70 %
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	1,73 %	-	1,41 %	-	-	-	-	-	1,73 %
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	1,74 %	-	1,41 %	-	-	-	-	-	1,73 %
Klasse E Thes.	1,47 %	-	1,45 %	1,69 %	1,00 %	1,45 %	1,45 %	1,39 %	-	-	1,20 %
Klasse E Thes. CHF	1,47 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,50 %	-	1,47 %	-	1,00 %	1,48 %	1,48 %	-	-	-	1,23 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,50 %	-	1,47 %	-	1,00 %	1,48 %	1,48 %	1,43 %	-	-	1,23 %
Klasse E Thes. GBP	1,47 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,50 %	-	1,47 %	-	1,00 %	1,48 %	1,48 %	-	-	-	1,23 %
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1,47 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	1,47 %	-	1,00 %	1,48 %	1,48 %	-	-	-	1,23 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	1,50 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1,74 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1,75 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1,75 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1,74 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1,75 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	0,18 %	0,15 %	0,15 %	0,14 %	0,15 %	0,15 %	0,15 %	0,15 %	0,14 %	0,15 %	0,17 %
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	0,16 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	0,16 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	0,15 %	-	-	0,16 %	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	0,16 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	1,34 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1,35 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss angegeben – und Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrunde liegenden Portfolio des strukturierten Produkts nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

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

Gesamtkostenquote (die „TER“) für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 (Forts.)

Anteilsklasse	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*	Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*	Schroder GAIA Sirius US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1,35 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	1,34 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	2,33 %	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	2,36 %	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	2,36 %	1,93 %	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,93 %	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1,50 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,39 %	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,42 %	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,43 %	-
Klasse X Thes.	-	-	-	1,58 %	-	-	-	1,54 %	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	0,78 %	-	-	1,60 %	-	-	-

Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss angegeben – und Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrunde liegenden Portfolio des strukturierten Produkts nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

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

Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

Risikoprofil und Hebelung

1. Commitment-Ansatz

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

Teilfonds
Schroder GAIA Sirios US Equity
Schroder GAIA Cat Bond

2. Relativer VaR-Ansatz

Dieser Ansatz wird für die Fonds verwendet, deren Risiko unter Bezugnahme auf eine festgelegte Benchmark gesteuert werden kann.

Teilfonds	VaR-Benchmark
Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*	70 % Russell 1000 (Total Return) Index und 30 % BBA LIBOR USD 3 Month Act 360

Angaben zur Verwendung des VaR-Limits und der Höhe der Hebelung

Die Höhe der Hebelung ist ein Indikator für die Derivateverwendung sowie eine etwaige Hebelung durch die Wiederanlage von als Sicherheit erhaltenen Barmitteln im Zuge des Einsatzes von Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung. Sonstige physische Vermögenswerte, die direkt im Portfolio der betreffenden Teilfonds gehalten werden, fließen nicht ein. Die Angabe ist nicht repräsentativ für den maximalen möglichen Verlust eines Teilfonds, da sie gleichermaßen die Derivate umfasst, die zum Schutz des Nettovermögens eines Teilfonds verwendet werden, als auch jene, die durch risikolose Vermögenswerte besichert werden, sowie jene, die aus wirtschaftlicher Sicht kein zusätzliches Engagement oder Marktrisiko und keine zusätzliche Hebelung generieren. Daher gibt die ausgewiesene Hebelung die wirtschaftliche Hebelung¹ des Teilfonds nicht wahrheitsgetreu wieder. Die ausgewiesene Höhe der Hebelung basiert auf dem Gesamtnennwert² aller von einem Teilfonds gehaltenen derivativen Finanzinstrumente und wird als Prozentsatz des Nettovermögens des Teilfonds ausgedrückt. Zum Zwecke dieser Berechnung heben die Bestände und die ausgleichenden Derivatpositionen („Long“- und „Short“-Positionen) sich nicht gegenseitig auf und die Zahl ist die Summe der Gesamtbestände (mit Ausnahme von Terminkontrakten zum Zwecke der Währungsabsicherung).

Teilfonds	Verwendung des aufsichtsrechtlichen VaR-Limits			Durchschnittliche Hebelung
	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	
Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*	0,00 %	84,01 %	58,00 %	91,00 %

Angaben zum VaR-Modell

Teilfonds	Modelltyp	Konfidenzintervall	Haltedauer	Beobachtungszeitraum
Schroder GAIA Nuveen US Equity Long Short*	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr

3. Absoluter VaR-Ansatz

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

Teilfonds
Schroder GAIA BlueTrend
Schroder GAIA Contour Tech Equity
Schroder GAIA Egerton Equity
Schroder GAIA Helix
Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*
Schroder GAIA Two Sigma Diversified
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Teilfonds	Verwendung des aufsichtsrechtlichen VaR-Limits			Durchschnittliche Hebelung
	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	
Schroder GAIA BlueTrend	30,00 %	79,65 %	49,75 %	2.303,40 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	29,33 %	95,41 %	49,22 %	156,50 %
Schroder GAIA Egerton Equity**	29,00 %	100,93 %	54,11 %	167,90 %
Schroder GAIA Helix	6,04 %	15,77 %	10,81 %	471,10 %

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

** 1 passiver Verstoß gegen die aufsichtsrechtliche VaR-Grenze wurde bei GAIA Egerton am 26. März 2020 festgestellt. Der absolute VaR betrug 20,186 %, bei einer aufsichtsrechtlichen Grenze von 20 %.

Der Verstoß resultierte aus Abflüssen und wurde am nächsten Tag durch Handelsgeschäfte zur Neugewichtung behoben.

¹ Dabei wird wirtschaftliche Hebelung verstanden als die Summe der Derivatverpflichtungen (berechnet gemäß ESMA 10/788) ohne die im Rahmen von Absicherungsgeschäften verwendeten Derivate, die Derivate, deren Verpflichtung durch risikolose Vermögenswerte gedeckt wird, und die Derivate, bei denen nicht angenommen wird, dass sie ein zusätzliches Engagement, Marktrisiko oder eine zusätzliche Hebelung generieren.

² Das Delta wird bei Bedarf gemäß ESMA 10/788 angepasst.

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

3. Absoluter VaR-Ansatz (Forts.)

Teilfonds	Verwendung des aufsichtsrechtlichen VaR-Limits			Durchschnittliche Hebelung
	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	
Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*	0,00 %	91,25 %	34,78 %	98,00 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	20,14 %	45,73 %	29,63 %	438,50 %
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	13,00 %	98,09 %	35,95 %	76,10 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	5,19 %	26,33 %	13,68 %	785,40 %

Angaben zum VaR-Modell

Teilfonds	Modelltyp	Konfidenzintervall	Haltedauer	Beobachtungszeitraum
Schroder GAIA BlueTrend	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Contour Tech Equity	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Egerton Equity	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Helix	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Nuveen US Equity Market Neutral*	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Wellington Pagosa	MonteCarlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr

OGAW-Vergütungsangaben für die Schroder Investment Management Europe S.A. („SIM Europe“) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 72 bis 108 des Jahresberichts und Abschlusses für 2019 (verfügbar auf der Website der Gruppe – www.schroders.com/annualreport2019) gelesen werden, der weitere Informationen zu den Aktivitäten unseres Vergütungsausschusses und zu unseren Vergütungsgrundsätzen und -richtlinien bietet.

Die wesentlichen OGAW-Risikoübernehmer („OGAW-MRTs“) der SIM Europe sind natürliche Personen, deren Rollen bei der Schroders-Gruppe einen erheblichen Einfluss auf das Risiko der SIM Europe oder der von ihr verwalteten OGAW-Fonds haben können. Diese Rollen werden im Einklang mit den Anforderungen der UCITS-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 UCITS-Richtlinie für alle UCITS MRTs eingehalten werden. Der Vergütungsausschuss und der Verwaltungsrat der Schroders plc prüfen die Vergütungsstrategie mindestens einmal jährlich. Der Verwaltungsrat der SIM Europe ist für die Verabschiedung der Vergütungsrichtlinie, die Prüfung ihrer allgemeinen Grundsätze mindestens einmal jährlich, für die Beaufsichtigung ihrer Umsetzung und für die Sicherstellung der Einhaltung der maßgeblichen lokalen Rechtsvorschriften verantwortlich. Die Vergütungspolitik wurde im Jahr 2019 überprüft, um sicherzustellen, dass sie mit den OGAW/AIFMD-Vergütungsanforderungen konform ist, und es wurden keine erheblichen Änderungen vorgenommen.

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

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

Die nachstehenden Vergütungsdaten spiegeln die im Jahr 2019 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 339 Mitarbeiter gezahlten Vergütung belief sich auf 46,19 Mio. EUR, wovon 34,11 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 12,08 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 wurden genutzt durch und erbrachten Dienstleistungen für andere Konzernunternehmen von Schroders, einschließlich infolge der Übertragung der Anlageverwaltung oder anderer Verantwortlichkeiten durch SIM Europe an andere Konzernunternehmen von Schroders oder Dritte. Viele dieser OGAW-MRTs erbringen auch Dienstleistungen für andere Konzernunternehmen von Schroders sowie andere Kunden. Daher ist nur ein Teil der Vergütung dieser Personen in den nachstehenden Gesamtvergütungszahlen enthalten, auf der Grundlage einer objektiven Verteilung anhand der Zusammensetzung der einzelnen Rollen unter Verwendung des maßgeblichen regulierten verwalteten Vermögens, auf das sich die jeweiligen Rollen beziehen, als Teil des gesamten verwalteten Vermögens. Die an die 241 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019 gezahlte und der Aktivitäten der OGAW-Verwaltungsgesellschaft von SIM Europe oder den von ihr verwalteten OGAW-Fonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 51,17 Mio. EUR, wovon 12,29 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 36,14 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW-Fonds übernehmen, und 2,74 Mio. EUR an andere OGAW-MRTs, einschließlich MRTs mit Kontrollfunktionen, gezahlt wurden. Diese Angaben zur Gesamtvergütung umfassen durch Beauftragte gezahlte Beträge, soweit verfügbar.

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

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

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 das Engagements des Teilfonds in Total Return Swaps für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 nachstehend 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
21.134.723	2,08 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
51.418.826	5,06 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
72.553.549	7,14 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2020 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	36.135.059
J.P. Morgan	14.690.291
Goldman Sachs	13.070.259
Merrill Lynch	7.551.359
UBS	1.106.581
	72.553.549

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert EUR
Barmittel	12.103.101
	12.103.101

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeits-	Marktwert EUR
weniger als 1 Tag	12.103.101
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	12.103.101

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	12.103.101
	12.103.101

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeits-	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	15.760.495	9.093.007	24.853.502
3 bis 12 Monate	5.374.228	18.961.835	24.336.063
mehr als 1 Jahr	-	23.363.984	23.363.984
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	21.134.723	51.418.826	72.553.549

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	12.103.101
	12.103.101

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	58.942.822
Gepoolt	-
Sonstige	-
	58.942.822

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite EUR*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettoverlust	50,50 %	40.993.775
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	49,50 %	40.174.205
	100,00 %	81.167.980

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
10.312.560	2,55 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
10.312.560	2,55 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2020 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Goldman Sachs	6.850.022
J.P. Morgan	3.462.538
	10.312.560

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	1.490.000
	1.490.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeits-	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	1.490.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	1.490.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1.490.000
	1.490.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeits-	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	9.785.352	9.785.352
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	355.193	355.193
mehr als 1 Jahr	-	172.015	172.015
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	-	10.312.560	10.312.560

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	1.490.000
	1.490.000

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	350.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	350.000

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

Rendite und Kosten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps**	2,43 %	449.128
Realisierter Nettogewinn	33,16 %	6.118.402
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	64,41 %	11.883.953
	100,00 %	18.451.483

* Absolut ausgedrückt.

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

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
2.053.468	0,41 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
11.692.324	2,36 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
13.745.792	2,77 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2020 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Goldman Sachs	4.388.979
Merrill Lynch	3.604.181
Morgan Stanley	3.130.525
Credit Suisse	2.610.776
Barclays Bank	11.331
	13.745.792

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	4.000.000
	4.000.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeits-	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	4.000.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	4.000.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	4.000.000
	4.000.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeits-	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	194.924	194.924
1 bis 4 Wochen	-	11.331	11.331
1 bis 3 Monate	-	478.420	478.420
3 bis 12 Monate	240.984	8.545.623	8.786.607
mehr als 1 Jahr	1.812.484	2.462.026	4.274.510
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	2.053.468	11.692.324	13.745.792

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	4.000.000
	4.000.000

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	810.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	810.000

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

Rendite und Kosten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	83,05 %	75.537.851
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	16,95 %	15.415.255
	100,00 %	90.953.106

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
3.847.192	0,27 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
3.847.192	0,27 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2020 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	3.847.192
	3.847.192

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	1.400.000
	1.400.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeits-	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	1.400.000
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	1.400.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1.400.000
	1.400.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeits-	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	3.847.192	-	3.847.192
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	3.847.192	-	3.847.192

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	1.400.000
	1.400.000

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2020 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

Rendite und Kosten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettogewinn	15,42 %	8.103.397
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	84,58 %	44.448.726
	100,00 %	52.552.123

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
7.781.401	1,41 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
9.436.998	1,71 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
17.218.399	3,12 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2020 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	7.868.799
Goldman Sachs	5.132.615
Morgan Stanley	4.216.985
	17.218.399

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	4.319.238
	4.319.238

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeits-	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	4.319.238
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	4.319.238

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	4.319.238
	4.319.238

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeits-	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	6	6
1 bis 3 Monate	-	95.150	95.150
3 bis 12 Monate	535.393	423.056	958.449
mehr als 1 Jahr	7.246.008	8.918.786	16.164.794
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	7.781.401	9.436.998	17.218.399

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	2.507.400
Goldman Sachs	1.365.838
Morgan Stanley	446.000
	4.319.238

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	2.614.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	2.614.000

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Rendite und Kosten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2020 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettoverlust	83,48 %	11.746.886
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	16,52 %	2.325.279
	100,00 %	14.072.165

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.



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 2020 DEDE