





## Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

# Halbjahresbericht

31. März 2024

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

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

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

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

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

## Inhalt

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

# Zusätzliche Informationen für Investoren in Österreich

## Bereitstellung von Einrichtungen für Anleger im Sinne von Art. 92 Richtlinie (EU) 2019/1160

Alle Zahlungen an Anleger, einschließlich Rücknahmeverlösen, potenziellen Ausschüttungen und anderen Zahlungen, können auf Anfrage über folgende Adresse geleistet werden:

### **HSBC Continental Europe, Luxembourg**

18, Boulevard de Kockelscheuer

L-1821 Luxemburg

Email: [simeudealing@schroders.com](mailto:simeudealing@schroders.com)

### **Die folgenden Einrichtungen sind auf [www.eifs.lu/schroders](http://www.eifs.lu/schroders) verfügbar:**

- Informationen darüber, wie Anträge (Zeichnung, Rückkauf und Rücknahme) getätigt werden können und wie Rückkauf- und Rücknahmeverlöse bezahlt werden;
- Informationen über Verfahren und Vereinbarungen im Zusammenhang mit Beschwerden, Verwaltung und Einreichungen von Anlegern;
- Informationen über die von den Einrichtungen durchgeführten Funktionen auf einem dauerhaften Datenträger;
- der neueste Verkaufsprospekt, die Satzung, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die wesentlichen Anlegerinformationen.

### **Steuerlicher Vertreter**

PwC PricewaterhouseCoopers Wirtschaftsprüfung und Steuerberatung GmbH, Erdbergstraße 200, 1030 Wien, hat für die Gesellschaft die Funktion des steuerlichen Vertreters in Österreich im Sinne von § 186 Abs 2 Z 2 iVm § 188 InvFG 2011 übernommen.

### **Veröffentlichung des Nettoinventarwerts / Mitteilungen an die Anteilsinhaber**

Die Nettoinventarwerte der Teilfonds sowie Mitteilungen an die Anteilsinhaber werden in Österreich täglich unter [www.schroders.com/at](http://www.schroders.com/at) veröffentlicht.

# Verwaltungsrat

## Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

**Non-Executive Director**

Vaults 13-16  
Valletta Waterfront  
1914 FRN  
Malta

## Weitere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche Garcia-Minaur**

**Global Head of Wealth, Client Group**

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

**Independent Director**

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

- **Bernard Herman**

**Independent Director**

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

- **Hugh Mullan**

**Independent Director**

5, rue Höhenhof  
L-1736 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

- **Ross Leach**

**Specialist Solutions**

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

- **Tim Boole**

**Head of Product Management Private Equity**

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

- **Yves Francis<sup>1</sup>**

**Independent Director**

67 rue du Pannebourg  
6700 Arlon  
Belgien

<sup>1</sup> Yves Francis wurde am 28. März 2024 in den Verwaltungsrat berufen.

# Verwaltung

## Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

## Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

### Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

## Hauptbuchstelle, Registerführer und Transferstelle

### HSBC Continental Europe, Luxembourg

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

## Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

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

## Hauptrechtsberater

### Arendt & Medernach S.A.

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

## Unabhängiger Abschlussprüfer

### KPMG Audit S.à r.l.

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

## Anlageverwalter

### Contour Asset Management, LLC

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

### Egerton Capital (UK) LLP

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

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

- Egerton Capital (US), LP.

### Oaktree Capital Management, LP

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

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

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

## Schroder Investment Management Limited

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

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

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

## Schroder Investment Management (Singapore) Ltd

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

## Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

## Select Equity Group LP

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

## Sirios Capital Management LP

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

## Systematica Investments Limited

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

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

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

## Two Sigma Advisers LP

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

## Wellington Management International Limited

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

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

- Wellington Management Company LLP.

# Bericht des Verwaltungsrats

## Die Gesellschaft

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

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

## Abschluss

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

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

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

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

## Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

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

Der Verwaltungsrat hat folgende Pflichten:

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

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

## Verwaltungsratssitzungen

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

## Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

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

## Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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



# Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

## Aktivitäten während des Berichtszeitraums

### 1. Neue Anteilklassen

Während des Berichtszeitraums wurden die folgenden Anteilklassen aufgelegt:

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

## Wesentliche Ereignisse während des Berichtszeitraums

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

### Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA  
31. März 2024

# Bericht des Anlageverwalters

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

## Wirtschaftlicher Rückblick

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

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

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

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

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

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

## Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

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

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

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

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

## Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

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

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

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

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

## Ausblick

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

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

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

### Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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

# Statistische Informationen

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

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

# Statistische Informationen (Forts.)

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

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

# Statistische Informationen (Forts.)

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

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

# Statistische Informationen (Forts.)

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

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

# Statistische Informationen (Forts.)

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

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

# Statistische Informationen (Forts.)

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

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



# Statistische Informationen (Forts.)

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

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

# Statistische Informationen (Forts.)

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

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

# Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2024

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

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

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

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

# Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2024 (Forts.)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

\*\* Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2023 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 28. März 2024.

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

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

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

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

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

\*\*\* Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2023 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 28. März 2024.

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



# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

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

# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

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

# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

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

# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024

## Schroder GAIA Asian Equity Long Short

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA BlueTrend

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

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond

| Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Nennbetrag | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die zu einer amtlichen<br>Börsennotierung<br>zugelassen sind | Markt-<br>wert<br>USD | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| <b>Aktien</b>                               |         |  |                       |                              |
| <b>Bermuda</b>                              |         |  | <b>7.667</b>          | <b>-</b>                     |
| 697   | USD     | Voussoir Re  | 7.667                 | -                            |
| <b>Supranational</b>                        |         |  | <b>74.240.103</b>     | <b>2,38</b>                  |
| 550   | USD     | Voussoir Re SideCar  | 123.200               | -                            |
| 697   | USD     | Voussoir Re<br>SideCar-Preference  | 48.790                | -                            |
| 530   | USD     | Voussoir Re<br>SideCar-Preference  | -                     | -                            |
| 557   | USD     | Voussoir Re<br>SideCar-Preference  | 63.841.669            | 2,05                         |
| 667   | USD     | Voussoir Re-Preference   | 10.226.444            | 0,33                         |
| <b>Summe Aktien</b>                         |         |  | <b>74.247.770</b>     | <b>2,38</b>                  |
| <b>Anleihen</b>                             |         |  |                       |                              |
| <b>Bermuda</b>                              |         |  | <b>279.663.078</b>    | <b>8,98</b>                  |
| 19.450.000                                  | USD     | Acorn Re 07/11/24,<br>variabel   | 19.378.035            | 0,63                         |
| 10.263.000                                  | USD     | Baldwin Re 07/07/25,<br>variabel   | 10.215.790            | 0,33                         |
| 2.667.000                                   | USD     | Blue Halo Re Series A<br>24/02/25, variabel  | 2.646.797             | 0,08                         |
| 3.500.000                                   | USD     | Blue Halo Re Series B<br>24/02/25, variabel  | 3.556.875             | 0,11                         |
| 500.000                                     | USD     | Bowline Re 23/05/25,<br>variabel   | 507.775               | 0,02                         |
| 2.500.000                                   | USD     | Citrus Re Series A<br>07/06/27, variabel   | 2.500.000             | 0,08                         |
| 4.500.000                                   | USD     | Citrus Re Series B<br>07/06/27, variabel   | 4.500.000             | 0,14                         |
| 89.359                                      | USD     | Eden Re II 20/03/26, ZCP   | 50.693                | -                            |
| 24.512.000                                  | USD     | Everglades Re II<br>14/05/24, variabel   | 24.684.196            | 0,80                         |
| 9.417.000                                   | USD     | Four Lakes Re 07/01/25,<br>variabel  | 9.135.432             | 0,29                         |
| 2.600.000                                   | USD     | Herbie Re 08/01/25,<br>variabel  | 2.597.270             | 0,08                         |
| 5.000.000                                   | USD     | Integrity Re 12/06/28,<br>variabel   | 3.312.500             | 0,11                         |
| 13.053.671                                  | USD     | Kilimanjaro III Re<br>Series A 19/12/24,<br>variabel   | 12.727.330            | 0,41                         |
| 12.087.000                                  | USD     | Kilimanjaro III Re<br>Series B 19/12/24,<br>variabel   | 12.006.017            | 0,39                         |
| 4.380.000                                   | USD     | Kilimanjaro III Re<br>Series B1 21/04/25,<br>variabel  | 4.378.248             | 0,14                         |
| 4.750.000                                   | USD     | Kilimanjaro III Re<br>Series C1 21/04/25,<br>variabel  | 4.780.638             | 0,15                         |
| 8.500.000                                   | USD     | Kilimanjaro III Re<br>Series B2 20/04/26,<br>variabel  | 8.485.550             | 0,27                         |

| Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Nennbetrag | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die zu einer amtlichen<br>Börsennotierung<br>zugelassen sind | Markt-<br>wert<br>USD | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| 4.100.000                                   | USD     | Kilimanjaro III Re<br>Series C2 20/04/26,<br>variabel  | 4.139.873             | 0,13                         |
| 11.188.861                                  | USD     | Kilimanjaro III Re<br>19/12/26, variabel   | 10.909.140            | 0,35                         |
| 593.390                                     | USD     | Manatee Re III 08/06/26,<br>variabel   | 118.678               | -                            |
| 25.602.000                                  | USD     | Merna Reinsurance II<br>08/07/24, variabel   | 25.619.280            | 0,83                         |
| 11.500.000                                  | USD     | Montoya Re 07/04/25,<br>variabel   | 11.612.125            | 0,37                         |
| 13.500.000                                  | USD     | Nakama Re 14/01/25,<br>variabel  | 13.530.038            | 0,43                         |
| 9.917.000                                   | USD     | Sanders Re II Series A<br>07/04/25, variabel   | 9.712.958             | 0,31                         |
| 18.947.000                                  | USD     | Sanders Re II Series A1<br>07/04/25, variabel  | 18.722.004            | 0,61                         |
| 11.750.000                                  | USD     | Sanders Re III Series A<br>07/06/25, variabel  | 12.219.119            | 0,39                         |
| 8.250.000                                   | USD     | Sanders Re III Series B<br>07/06/25, variabel  | 8.411.081             | 0,27                         |
| 8.750.000                                   | USD     | Sanders Re III 07/04/26,<br>variabel   | 8.075.375             | 0,26                         |
| 6.256.000                                   | USD     | Tailwind Re Series A<br>08/01/25, variabel   | 6.219.090             | 0,20                         |
| 14.958.000                                  | USD     | Tailwind Re Series B<br>08/01/25, variabel   | 14.768.407            | 0,47                         |
| 9.902.000                                   | USD     | Tailwind Re Series C<br>08/01/25, variabel   | 9.889.870             | 0,32                         |
| 250.000                                     | USD     | Tailwind Re Series D<br>08/01/25, variabel   | 252.894               | 0,01                         |
| <b>Irland</b>                               |         |  | <b>33.590.878</b>     | <b>1,08</b>                  |
| 8.750.000                                   | EUR     | King Max Re Designated<br>Activity 06/01/27,<br>variable   | 9.535.753             | 0,31                         |
| 23.000.000                                  | USD     | Queen Street 2023 Re<br>DAC 08/12/25, variabel   | 24.055.125            | 0,77                         |
| <b>Singapur</b>                             |         |  | <b>76.310.140</b>     | <b>2,45</b>                  |
| 7.750.000                                   | USD     | Integrity Re II 12/04/28,<br>variabel  | 174.375               | 0,01                         |
| 6.250.000                                   | USD     | Kizuna Re III 07/04/26,<br>variabel  | 6.222.969             | 0,20                         |
| 54.825.000                                  | USD     | Nakama Re Series 1<br>13/10/26, variabel   | 54.204.106            | 1,73                         |
| 1.125.000                                   | USD     | Phoenix 2 Re 04/01/38,<br>ZCP  | 1.716.500             | 0,06                         |
| 3.000.000                                   | USD     | Phoenix 2 Re Series 24B<br>04/01/38, ZCP   | 3.399.250             | 0,11                         |
| 4.012.000                                   | USD     | Phoenix 3 Re 04/01/29,<br>ZCP  | 4.633.377             | 0,15                         |
| 10.000.000                                  | NZD     | Totara Re 08/06/27,<br>13,39 %   | 5.959.563             | 0,19                         |
| <b>Supranational</b>                        |         |  | <b>13.421.869</b>     | <b>0,43</b>                  |

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

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

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

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

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



# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

| Anzahl der<br>Anteile oder<br>Nennbetrag | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die an einem anderen<br>geregelt Markt<br>gehandelt werden | Markt-<br>wert<br>USD | % des<br>Netto-<br>ver-<br>mögens | Anzahl der<br>Anteile oder<br>Nennbetrag | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die an einem anderen<br>geregelt Markt<br>gehandelt werden | Markt-<br>wert<br>USD | % des<br>Netto-<br>ver-<br>mögens |                   |             |  |  |  |
|--|---------|--|-----------------------|-----------------------------------|--|---------|--|-----------------------|-----------------------------------|-------------------|-------------|--|--|--|
| <b>Kaimaninseln</b>                      |         |  |                       |                                   | <b>188.509.191</b>                       |         |  |                       |                                   | <b>6,05</b>       |             |  |  |  |
| 1.092.500                                | USD     | Caelus Re V Series B<br>05/06/24, variabel   | 1.082.941             | 0,03                              | 4.000.000                                | USD     | Vitality Re XIII Series B<br>06/01/26, variabel  | 3.970.500             | 0,13                              |                   |             |  |  |  |
| 3.747.995                                | USD     | Caelus Re V Series C<br>05/06/24, variabel   | 1.293.058             | 0,04                              | 14.000.000                               | USD     | Vitality Re XIV Series A<br>05/01/27, variabel   | 14.258.300            | 0,46                              |                   |             |  |  |  |
| 11.550.000                               | USD     | Caelus Re VI 07/06/24,<br>variabel   | 11.558.374            | 0,37                              | 5.550.000                                | USD     | Vitality Re XIV Series B<br>05/01/27, variabel   | 5.727.184             | 0,18                              |                   |             |  |  |  |
| 18.500.000                               | USD     | Fish Pond Re 08/01/27,<br>variable   | 18.621.175            | 0,59                              | 11.022.000                               | USD     | Vitality Re XV Series A<br>07/01/28, variabel  | 11.023.929            | 0,35                              |                   |             |  |  |  |
| 800.000                                  | USD     | Long Point Re IV<br>01/06/26, variabel   | 806.520               | 0,03                              | 4.320.000                                | USD     | Vitality Re XV Series B<br>07/01/28, variabel  | 4.361.040             | 0,14                              |                   |             |  |  |  |
| 1.480.545                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2019 06/06/26, variabel   | 1.312.910             | 0,04                              | <b>Hongkong</b>                          |         |  |                       |                                   | <b>15.063.060</b> | <b>0,48</b> |  |  |  |
| 6.154.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2020 06/06/24, variabel   | 6.145.077             | 0,20                              | 11.558.000                               | USD     | Black Kite Re 09/06/25,<br>variabel  | 11.764.310            | 0,37                              |                   |             |  |  |  |
| 7.984.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2020 Series 3 06/12/24,<br>variabel   | 7.748.871             | 0,25                              | 3.250.000                                | USD     | Great Wall Re 05/01/26,<br>variabel  | 3.298.750             | 0,11                              |                   |             |  |  |  |
| 5.000.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2020 Series 4 06/12/24,<br>variabel   | 4.892.625             | 0,16                              | <b>Irland</b>                            |         |  |                       |                                   | <b>89.221.598</b> | <b>2,86</b> |  |  |  |
| 4.250.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2021 Series 11 06/06/25,<br>variabel  | 3.792.063             | 0,12                              | 19.425.000                               | USD     | Atlas Capital<br>Reinsurance 2020 DAC<br>10/06/24, variabel  | 19.573.601            | 0,63                              |                   |             |  |  |  |
| 8.285.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2021 Series 12 06/06/25,<br>variabel  | 7.693.037             | 0,25                              | 16.500.000                               | USD     | Atlas Capital<br>Reinsurance 2022<br>Designated Activity<br>06/06/25, variabel   | 17.280.450            | 0,55                              |                   |             |  |  |  |
| 4.642.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2021 Series 13 06/06/25,<br>variabel  | 4.441.001             | 0,14                              | 8.000.000                                | EUR     | Azzurro Re II DAC<br>20/04/28, variabel  | 8.673.954             | 0,28                              |                   |             |  |  |  |
| 6.500.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2021 Series 14 06/06/25,<br>variabel  | 6.247.475             | 0,20                              | 19.500.000                               | EUR     | Lion III Re DAC 16/07/25,<br>variabel  | 20.739.893            | 0,67                              |                   |             |  |  |  |
| 17.416.667                               | USD     | Residential Reinsurance<br>2021 Series 2 06/12/25,<br>variabel   | 16.534.948            | 0,53                              | 5.250.000                                | EUR     | Orange Capital Re DAC<br>17/01/25, variabel  | 5.685.061             | 0,18                              |                   |             |  |  |  |
| 4.310.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2021 Series 3 06/12/25,<br>variabel   | 4.081.462             | 0,13                              | 2.042.000                                | EUR     | Orange Capital Re DAC<br>08/01/27, variabel  | 2.253.956             | 0,07                              |                   |             |  |  |  |
| 6.300.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2022 Series 13 06/06/26,<br>variabel  | 5.982.480             | 0,19                              | 4.000.000                                | EUR     | Taranis Reinsurance DAC<br>21/01/28, variabel  | 4.466.439             | 0,14                              |                   |             |  |  |  |
| 2.950.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2022 Series 14 06/06/26,<br>variabel  | 2.799.845             | 0,09                              | 9.769.000                                | EUR     | Windmill II Re DAC<br>05/07/24, variabel   | 10.548.244            | 0,34                              |                   |             |  |  |  |
| 3.750.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2022 Series 3 06/12/26,<br>variabel   | 3.899.156             | 0,13                              | <b>Singapur</b>                          |         |  |                       |                                   | <b>84.748.068</b> | <b>2,72</b> |  |  |  |
| 8.500.000                                | USD     | Residential Reinsurance<br>2022 Series 5 06/12/26,<br>variabel   | 8.627.925             | 0,28                              | 4.000.000                                | USD     | Astro Re 08/07/25,<br>variabel   | 3.400.000             | 0,11                              |                   |             |  |  |  |
| 12.044.000                               | USD     | Vitality Re XII Series A<br>07/01/25, variabel   | 12.062.066            | 0,39                              | 12.000.000                               | USD     | Catahoula II Re Series A<br>16/06/25, variabel   | 12.465.000            | 0,40                              |                   |             |  |  |  |
| 6.000.000                                | USD     | Vitality Re XII Series B<br>07/01/25, variabel   | 5.985.600             | 0,19                              | 5.250.000                                | USD     | Catahoula II Re Series B<br>16/06/25, variabel   | 5.469.056             | 0,18                              |                   |             |  |  |  |
| 13.648.000                               | USD     | Vitality Re XIII Series A<br>06/01/26, variabel  | 13.559.629            | 0,44                              | 14.866.000                               | USD     | First Coast Re III<br>07/04/25, variabel   | 14.416.675            | 0,46                              |                   |             |  |  |  |
|  |         |  |                       |                                   | 8.957.000                                | EUR     | Hexagon III Re 15/01/26,<br>variabel   | 9.325.045             | 0,30                              |                   |             |  |  |  |
|  |         |  |                       |                                   | 5.000.000                                | EUR     | Hexagon III Re<br>Series CAT 15/01/26,<br>variabel   | 4.989.681             | 0,16                              |                   |             |  |  |  |
|  |         |  |                       |                                   | 6.786.000                                | USD     | Kizuna Re III 09/04/29,<br>variabel  | 6.793.804             | 0,22                              |                   |             |  |  |  |
|  |         |  |                       |                                   | 17.714.000                               | USD     | Nakama Re Series 2<br>13/10/26, variabel   | 17.704.701            | 0,56                              |                   |             |  |  |  |
|  |         |  |                       |                                   | 5.000.000                                | USD     | Umigame Re Series A1<br>07/04/25, variabel   | 4.959.750             | 0,16                              |                   |             |  |  |  |

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

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

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Contour Tech Equity

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

## Schroder GAIA Egerton Equity

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix

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

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

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

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

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



# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

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

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

| Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Nennbetrag  | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die an einem anderen<br>geregelten Markt<br>gehandelt werden | Markt-<br>wert<br>USD | %<br>Netto-<br>ver-<br>mögen |
|--|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| <b>Anleihen</b>  |         |  |                       |                              |
| <b>Argentinien</b>   |         |  | <b>234.100</b>        | <b>0,08</b>                  |
| 229.000  | USD     | YPF 17/01/31, 9,50 %   | 234.100               | 0,08                         |
| <b>Brasilien</b>   |         |  | <b>413.883</b>        | <b>0,15</b>                  |
| 456.361  | USD     | MC Brazil Downstream<br>Trading 30/06/31, 7,25 %   | 413.883               | 0,15                         |
| <b>Ägypten</b>   |         |  | <b>410.357</b>        | <b>0,15</b>                  |
| 1.000.000  | EGP     | Egypt Treasury Bills<br>10/12/24, ZCP  | 17.422                | 0,01                         |
| 24.000.000   | EGP     | Egypt Treasury Bills<br>18/03/25, ZCP  | 392.935               | 0,14                         |
| <b>USA</b>   |         |  | <b>17.472.156</b>     | <b>6,19</b>                  |
| 8.150.300  | USD     | United States Treasury<br>Bill 04/04/24, ZCP   | 8.143.230             | 2,88                         |
| 7.129.800  | USD     | United States Treasury<br>Bill 11/04/24, ZCP   | 7.116.483             | 2,52                         |
| 50.900   | USD     | United States Treasury<br>Bill 18/04/24, ZCP   | 50.754                | 0,02                         |
| 1.014.500  | USD     | United States Treasury<br>Bill 25/04/24, ZCP   | 1.010.555             | 0,36                         |
| 50.700   | USD     | United States Treasury<br>Bill 09/05/24, ZCP   | 50.398                | 0,02                         |
| 50.700   | USD     | United States Treasury<br>Bill 16/05/24, ZCP   | 50.349                | 0,02                         |
| 50.500   | USD     | United States Treasury<br>Bill 23/05/24, ZCP   | 50.095                | 0,02                         |
| 1.009.400  | USD     | United States Treasury<br>Bill 30/05/24, ZCP   | 1.000.292             | 0,35                         |
| <b>Sambia</b>  |         |  | <b>291.965</b>        | <b>0,10</b>                  |
| 300.000  | USD     | First Quantum Minerals<br>01/06/31, 8,63%  | 291.965               | 0,10                         |
| <b>Summe Anleihen</b>  |         |  | <b>18.822.461</b>     | <b>6,67</b>                  |
| <b>Summe übertragbare Wertpapiere und<br/>Geldmarktinstrumente, die an einem anderen<br/>geregelten Markt<br/>gehandelt werden</b> |         |  | <b>18.822.461</b>     | <b>6,67</b>                  |

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

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

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

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

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

| Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Nennbetrag |     | Währung  | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die an einem anderen<br>geregelten Markt<br>gehandelt werden | Markt-<br>wert<br>USD | %<br>Netto-<br>ver-<br>mögen | Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Nennbetrag |              | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die an einem anderen<br>geregelten Markt<br>gehandelt werden | Markt-<br>wert<br>USD                          | %<br>Netto-<br>ver-<br>mögen |      |
|---|-----|--|--|-----------------------|------------------------------|---|--------------|---------|--|--|------------------------------|------|
| <b>Singapur</b>                             |     |  |  |                       |                              | <b>49.719</b>                               | <b>0,07</b>  | 305.000 | USD  | ASP Unifrax Holdings<br>30/09/28, 5,25 %       | 199.459                      | 0,26 |
| 5.000                                       | USD | Sea 01/12/25, 2,38 %   | 5.025  | 0,01                  |                              |   | 240.000      | USD     | B&G Foods 15/09/28,<br>8,00 %  | 250.210  | 0,33                         |      |
| 52.000                                      | USD | Sea 15/09/26, 0,25 %   | 44.694   | 0,06                  |                              |   | 50.000       | USD     | Bausch Health 01/02/27,<br>6,13 %  | 31.202   | 0,04                         |      |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>               |     |  |  |                       |                              | <b>113.595</b>                              | <b>0,15</b>  | 55.000  | USD  | Bausch Health 01/06/28,<br>4,88 %              | 30.067                       | 0,04 |
| 100.000                                     | GBP | Virgin Media Vendor<br>Financing Notes III DAC<br>15/07/28, 4,88 % | 113.595  | 0,15                  |                              |   | 375.000      | USD     | BellRing Brands<br>15/03/30, 7,00 %  | 386.690  | 0,51                         |      |
| <b>USA</b>                                  |     |  |  |                       |                              | <b>38.287.389</b>                           | <b>50,53</b> | 280.137 | USD  | Blackbird Capital Aircraft<br>15/07/46, 2,44 % | 246.983                      | 0,33 |
| 195.000                                     | USD | Academy 15/11/27,<br>6,00 %  | 192.795  | 0,25                  |                              |   | 15.000       | USD     | Blackline 15/03/26, ZCP  | 13.647   | 0,02                         |      |
| 300.000                                     | USD | Acuris Finance US<br>01/05/28, 5,00 %                              | 272.823  | 0,36                  |                              |   | 370.000      | USD     | Bloomin' Brands<br>15/04/29, 5,13 %  | 344.100  | 0,45                         |      |
| 12.000                                      | USD | Advanced Energy<br>Industries 15/09/28,<br>2,50 %                  | 12.263   | 0,02                  |                              |   | 135.000      | USD     | Boost Newco Borrower<br>15/01/31, 7,50 %   | 141.492  | 0,19                         |      |
| 14.000                                      | USD | Akamai Technologies<br>01/09/27, 0,38 %                            | 14.805   | 0,02                  |                              |   | 6.000        | USD     | Bridgebio Pharma<br>15/03/27, 2,50 %   | 6.458  | 0,01                         |      |
| 29.000                                      | USD | Alarm.com Holdings<br>15/01/26, ZCP                                | 26.695   | 0,04                  |                              |   | 11.000       | USD     | Bridgebio Pharma<br>01/02/29, 2,25 %   | 9.013  | 0,01                         |      |
| 310.000                                     | USD | Albertsons 15/02/28,<br>5,88 %                                     | 307.142  | 0,41                  |                              |   | 320.000      | USD     | Brinker International<br>15/07/30, 8,25 %  | 337.429  | 0,45                         |      |
| 60.000                                      | USD | Albertsons 15/02/30,<br>4,88 %                                     | 57.130   | 0,08                  |                              |   | 250.000      | USD     | BRSP 19/08/38, variabel  | 227.323  | 0,30                         |      |
| 82.000                                      | USD | Alliant Energy 15/03/26,<br>3,88 %                                 | 81.057   | 0,11                  |                              |   | 10.000       | USD     | Burlington Stores<br>15/12/27, 1,25 %  | 12.780   | 0,02                         |      |
| 135.000                                     | USD | Allied Universal<br>01/06/28, 4,63 %                               | 123.457  | 0,16                  |                              |   | 14.000       | USD     | Cable One 15/03/26, ZCP  | 12.264   | 0,02                         |      |
| 115.000                                     | USD | Allied Universal Finance<br>15/07/26, 6,63 %                       | 115.055  | 0,15                  |                              |   | 125.000      | USD     | Cablevision Lightpath<br>15/09/27, 3,88 %  | 112.361  | 0,15                         |      |
| 170.000                                     | USD | Allied Universal Holdco<br>15/02/31, 7,88 %                        | 172.430  | 0,23                  |                              |   | 235.000      | USD     | Cablevision Lightpath<br>15/09/28, 5,63 %  | 196.517  | 0,26                         |      |
| 7.000                                       | USD | Anylam Pharmaceuticals<br>15/09/27, 1,00 %                         | 6.614  | 0,01                  |                              |   | 415.000      | USD     | Calpine 01/02/29, 4,63 %   | 384.512  | 0,51                         |      |
| 15.000                                      | USD | Alphatec Holdings<br>01/08/26, 0,75 %                              | 15.656   | 0,02                  |                              |   | 240.000      | USD     | Calpine 01/02/31, 5,00 %   | 220.376  | 0,29                         |      |
| 75.000                                      | USD | AMC Networks 15/01/29,<br>10,25 %                                  | 75.516   | 0,10                  |                              |   | 165.000      | USD     | Carnival 01/05/29,<br>6,00 %   | 162.842  | 0,21                         |      |
| 275.000                                     | USD | AMC Networks 15/02/29,<br>4,25 %                                   | 195.018  | 0,26                  |                              |   | 260.000      | USD     | Carnival 01/06/30,<br>10,50 %  | 284.583  | 0,38                         |      |
| 39.000                                      | USD | American Water Capital<br>15/06/26, 3,63 %                         | 38.230   | 0,05                  |                              |   | 265.653      | USD     | Castlelake Aircraft<br>Structured Trust 2017-1R<br>15/08/41, 2,74 %  | 245.278  | 0,32                         |      |
| 255.000                                     | USD | Amsted Industries<br>01/07/27, 5,63 %                              | 251.383  | 0,33                  |                              |   | 105.000      | USD     | CCO Holdings 01/03/30,<br>4,75 %   | 90.436   | 0,12                         |      |
| 90.000                                      | USD | APX Group 15/02/27,<br>6,75 %                                      | 90.397   | 0,12                  |                              |   | 455.000      | USD     | CCO Holdings 01/06/33,<br>4,50 %   | 355.786  | 0,47                         |      |
| 250.000                                     | USD | Arbor Realty Commercial<br>Real Estate Notes<br>15/05/36, variabel | 237.197  | 0,31                  |                              |   | 350.000      | USD     | Central Parent 15/06/29,<br>8,00 %   | 363.049  | 0,48                         |      |
| 290.000                                     | USD | Ardagh Holdings USA<br>15/08/26, 4,13 %                            | 262.907  | 0,35                  |                              |   | 11.000       | USD     | Cheesecake Factory<br>15/06/26, 0,38 %   | 9.844  | 0,01                         |      |
| 103.000                                     | USD | AREIT Trust 14/09/36,<br>variabel                                  | 98.577   | 0,13                  |                              |   | 535.000      | USD     | Churchill Downs<br>01/05/31, 6,75 %  | 538.702  | 0,70                         |      |
| 9.000                                       | USD | Array Technologies<br>01/12/28, 1,00 %                             | 8.355  | 0,01                  |                              |   | 330.000      | USD     | CITGO Petroleum<br>15/06/25, 7,00 %  | 329.908  | 0,44                         |      |
|   |     |  |  |                       |                              |   | 35.000       | USD     | Citigroup 13/02/30,<br>variabel  | 34.868   | 0,05                         |      |

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

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

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



# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

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

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

\* Notleidendes Wertpapier.

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA SEG US Equity

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Sirios US Equity

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

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

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa

| Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Nennbetrag | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die zu einer amtlichen<br>Börsennotierung<br>zugelassen sind | Markt-<br>wert<br>USD | %<br>Netto-<br>ver-<br>mögen |
|---|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| <b>Aktien</b>                               |         |  |                       |                              |
| <b>Australien</b>                           |         |  | <b>1.064.605</b>      | <b>0,33</b>                  |
| 193.771                                     | GBP     | Glencore   | 1.064.605             | 0,33                         |
| <b>Österreich</b>                           |         |  | <b>2.030.196</b>      | <b>0,64</b>                  |
| 16.494                                      | EUR     | Addiko Bank  | 319.412               | 0,10                         |
| 22.819                                      | EUR     | BAWAG Group  | 1.445.094             | 0,46                         |
| 5.963                                       | EUR     | Erste Group Bank   | 265.690               | 0,08                         |
| <b>Belgien</b>                              |         |  | <b>492.454</b>        | <b>0,15</b>                  |
| 3.025                                       | USD     | Galapagos  | 97.405                | 0,03                         |
| 4.464                                       | EUR     | KBC Group  | 334.326               | 0,10                         |
| 492   | EUR     | UCB  | 60.723                | 0,02                         |
| <b>Brasilien</b>                            |         |  | <b>202.743</b>        | <b>0,06</b>                  |
| 117.488                                     | BRL     | Hapvida Participacoes e<br>Investimentos   | 86.674                | 0,03                         |
| 23.000                                      | BRL     | Rede D'Or Sao Luiz   | 116.069               | 0,03                         |
| <b>Kanada</b>                               |         |  | <b>8.961.224</b>      | <b>2,82</b>                  |
| 124.298                                     | CAD     | Advantage Energy   | 906.622               | 0,28                         |
| 114.624                                     | CAD     | ARC Resources  | 2.043.608             | 0,65                         |
| 6.318                                       | USD     | Canadian Natural<br>Resources  | 482.190               | 0,15                         |
| 34.615                                      | USD     | Cenovus Energy   | 691.954               | 0,22                         |
| 3.200                                       | USD     | Clementia<br>Pharmaceuticals   | -                     | -                            |
| 13.529                                      | CAD     | Crew Energy  | 46.443                | 0,01                         |
| 76.952                                      | CAD     | Enerplus   | 1.511.714             | 0,48                         |
| 12.497                                      | CAD     | Headwater Exploration  | 70.763                | 0,02                         |
| 71.681                                      | CAD     | Kelt Exploration   | 320.158               | 0,10                         |
| 22.518                                      | CAD     | MEG Energy   | 517.006               | 0,16                         |
| 74.604                                      | CAD     | NuVista Energy   | 654.310               | 0,21                         |
| 90.877                                      | CAD     | Peyto Exploration &<br>Development   | 1.001.656             | 0,31                         |
| 6.042                                       | CAD     | Rogers Communications  | 247.559               | 0,08                         |
| 2.823                                       | USD     | Shopify  | 217.851               | 0,07                         |
| 1.467                                       | USD     | Teck Resources   | 67.159                | 0,02                         |
| 4.233                                       | USD     | Xenon Pharmaceuticals  | 182.231               | 0,06                         |
| <b>Chile</b>                                |         |  | <b>49.329</b>         | <b>0,02</b>                  |
| 4.821                                       | CAD     | Lundin Mining  | 49.329                | 0,02                         |
| <b>China</b>                                |         |  | <b>1.214.630</b>      | <b>0,38</b>                  |
| 17.777                                      | HKD     | Alibaba Group Holding  | 159.557               | 0,05                         |
| 2.600                                       | CNH     | Contemporary Amperex<br>Technology   | 67.586                | 0,02                         |
| 337.000                                     | HKD     | CSC Financial  | 255.325               | 0,08                         |
| 5.488                                       | HKD     | ENN Energy Holdings  | 42.281                | 0,01                         |
| 8.785                                       | USD     | KE Holdings  | 120.618               | 0,04                         |
| 7.000                                       | HKD     | Keymed Biosciences   | 30.319                | 0,01                         |

| Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Nennbetrag | Währung | Übertragbare<br>Wertpapiere und<br>Geldmarktinstrumente,<br>die zu einer amtlichen<br>Börsennotierung<br>zugelassen sind | Markt-<br>wert<br>USD | %<br>Netto-<br>ver-<br>mögen |
|---|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| 69.000                                      | HKD     | Shandong Weigao<br>Group Medical Polymer   | 43.021                | 0,01                         |
| 7.400                                       | HKD     | Sichuan Kelun-Biotech<br>Biopharmaceutical   | 146.546               | 0,05                         |
| 6.264                                       | HKD     | Tencent Holdings   | 243.136               | 0,08                         |
| 4.900                                       | CNH     | WuXi AppTec  | 31.732                | 0,01                         |
| 4.651                                       | USD     | Zai Lab  | 74.509                | 0,02                         |
| <b>Dänemark</b>                             |         |  | <b>1.166.627</b>      | <b>0,37</b>                  |
| 181.520                                     | DKK     | Alm Brand  | 345.510               | 0,11                         |
| 2.707                                       | USD     | Ascendis Pharma  | 409.217               | 0,13                         |
| 522   | DKK     | Genmab   | 157.343               | 0,05                         |
| 5.966                                       | DKK     | Topdanmark   | 254.557               | 0,08                         |
| <b>Frankreich</b>                           |         |  | <b>3.921.906</b>      | <b>1,23</b>                  |
| 10.087                                      | EUR     | ALD  | 71.279                | 0,02                         |
| 967   | EUR     | Dassault Aviation  | 212.823               | 0,07                         |
| 2.387                                       | EUR     | Engie  | 39.942                | 0,01                         |
| 5.791                                       | EUR     | Legrand  | 613.641               | 0,19                         |
| 824   | EUR     | LVMH Moet Hennessy<br>Louis Vuitton  | 741.136               | 0,23                         |
| 7.699                                       | EUR     | Renault  | 388.682               | 0,12                         |
| 58.529                                      | EUR     | Société Générale   | 1.566.603             | 0,50                         |
| 2.483                                       | EUR     | TotalEnergies  | 170.022               | 0,05                         |
| 5.597                                       | EUR     | Ubisoft Entertainment  | 117.778               | 0,04                         |
| <b>Deutschland</b>                          |         |  | <b>4.088.698</b>      | <b>1,28</b>                  |
| 889   | EUR     | Allianz  | 266.437               | 0,08                         |
| 41.604                                      | EUR     | Commerzbank  | 571.379               | 0,18                         |
| 43.762                                      | EUR     | Deutsche Bank  | 688.455               | 0,22                         |
| 21.654                                      | USD     | Immatics   | 227.584               | 0,07                         |
| 752   | EUR     | Münchener<br>Rückversicherungs-<br>Gesellschaft in München   | 366.949               | 0,12                         |
| 648   | EUR     | Rheinmetall  | 364.228               | 0,11                         |
| 1.641                                       | EUR     | RWE  | 55.697                | 0,02                         |
| 3.480                                       | EUR     | SAP  | 677.519               | 0,21                         |
| 97.954                                      | GBP     | Sirius Real Estate   | 121.098               | 0,04                         |
| 9.463                                       | EUR     | Talanx   | 749.352               | 0,23                         |
| <b>Griechenland</b>                         |         |  | <b>539.032</b>        | <b>0,17</b>                  |
| 128.905                                     | EUR     | Piraeus Financial<br>Holdings  | 539.032               | 0,17                         |
| <b>Irland</b>                               |         |  | <b>672.910</b>        | <b>0,21</b>                  |
| 110.285                                     | EUR     | AIB Group  | 559.686               | 0,17                         |
| 4.571                                       | USD     | Prothena   | 113.224               | 0,04                         |
| <b>Italien</b>                              |         |  | <b>3.333.841</b>      | <b>1,05</b>                  |
| 38.644                                      | EUR     | Banca Mediolanum   | 424.415               | 0,13                         |
| 155.996                                     | EUR     | Banca Monte dei Paschi<br>di Siena   | 706.844               | 0,22                         |

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

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

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



# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

| Anzahl der Anteile oder Nennbetrag | Währung | Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind | Marktwert USD | % Nettovermögen | Anzahl der Anteile oder Nennbetrag | Währung | Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind | Marktwert USD      | % Nettovermögen |
|------------------------------------|---------|---|---------------|-----------------|------------------------------------|---------|---|--------------------|-----------------|
| 3.594                              | USD     | Marathon Oil  | 101.854       | 0,03            | 4.216                              | USD     | Shutterstock  | 193.135            | 0,06            |
| 812                                | USD     | Marathon Petroleum  | 163.618       | 0,05            | 2.471                              | USD     | SilverBow Resources   | 84.360             | 0,03            |
| 16.867                             | USD     | Matador Resources   | 1.126.210     | 0,35            | 3.778                              | USD     | Skyline Champion  | 321.168            | 0,10            |
| 5.323                              | USD     | Merck   | 702.370       | 0,22            | 400                                | USD     | Spotify Technology  | 105.560            | 0,03            |
| 2.499                              | USD     | Micron Technology   | 294.607       | 0,09            | 6.020                              | USD     | StepStone Group   | 215.155            | 0,07            |
| 695                                | USD     | Microsoft   | 292.400       | 0,09            | 7.212                              | USD     | Structure Therapeutics  | 309.106            | 0,10            |
| 466                                | USD     | Molina Healthcare   | 191.447       | 0,06            | 14.983                             | USD     | Sunrun  | 197.476            | 0,06            |
| 90                                 | USD     | MongoDB   | 32.278        | 0,01            | 8.140                              | USD     | Surgery Partners  | 242.816            | 0,08            |
| 12.180                             | USD     | Morgan Stanley  | 1.146.869     | 0,36            | 8.115                              | USD     | Syndax Pharmaceuticals  | 193.137            | 0,06            |
| 1.025                              | USD     | Morningstar   | 316.079       | 0,10            | 261                                | USD     | Synopsis  | 149.162            | 0,05            |
| 658                                | USD     | Morphic Holding   | 23.162        | 0,01            | 166                                | USD     | Take-Two Interactive Software   | 24.649             | 0,01            |
| 15.592                             | USD     | Nasdaq  | 983.855       | 0,31            | 11.685                             | USD     | Targa Resources   | 1.308.603          | 0,41            |
| 11.443                             | USD     | Navigator Holdings  | 175.650       | 0,06            | 192                                | USD     | Target  | 34.024             | 0,01            |
| 9.740                              | USD     | Net Power   | 110.939       | 0,03            | 4.759                              | USD     | Tenaris   | 186.886            | 0,06            |
| 412                                | USD     | Netflix   | 250.220       | 0,08            | 175                                | USD     | Thermo Fisher Scientific  | 101.712            | 0,03            |
| 8.009                              | USD     | News  | 209.676       | 0,07            | 3.215                              | USD     | Tidewater   | 295.780            | 0,09            |
| 11.207                             | USD     | NextDecade  | 63.656        | 0,02            | 504                                | USD     | TKO Group Holdings  | 43.551             | 0,01            |
| 1.122                              | USD     | NextEra Energy  | 71.707        | 0,02            | 1.722                              | USD     | T-Mobile US   | 281.065            | 0,09            |
| 904                                | USD     | NEXTracker  | 50.868        | 0,02            | 14.433                             | USD     | TPG   | 645.155            | 0,20            |
| 3.984                              | USD     | NiSource  | 110.197       | 0,03            | 4.260                              | USD     | Tradeweb Markets  | 443.764            | 0,14            |
| 3.285                              | USD     | Northern Trust  | 292.102       | 0,09            | 1.290                              | USD     | Uber Technologies   | 99.317             | 0,03            |
| 2.120                              | USD     | Nuvalent  | 159.191       | 0,05            | 2.090                              | USD     | United Therapeutics   | 480.115            | 0,15            |
| 1.469                              | USD     | NVIDIA  | 1.327.330     | 0,42            | 1.403                              | USD     | UnitedHealth Group  | 694.064            | 0,22            |
| 3.433                              | USD     | ONE Gas   | 221.531       | 0,07            | 3.401                              | USD     | Valaris   | 255.959            | 0,08            |
| 5.286                              | USD     | Ovintiv   | 274.343       | 0,09            | 873                                | USD     | Valero Energy   | 149.012            | 0,05            |
| 4.095                              | USD     | Penn Entertainment  | 74.570        | 0,02            | 397                                | USD     | Vaxcyte   | 27.119             | 0,01            |
| 2.822                              | USD     | PG&E  | 47.297        | 0,01            | 285                                | USD     | Vertex Pharmaceuticals  | 119.133            | 0,04            |
| 3.875                              | USD     | Phillips 66   | 632.943       | 0,20            | 50.449                             | USD     | Viper Energy  | 1.940.269          | 0,62            |
| 3.468                              | USD     | Pinterest   | 120.236       | 0,04            | 10.785                             | USD     | Walmart   | 648.933            | 0,20            |
| 2.548                              | USD     | PPL   | 70.146        | 0,02            | 14.239                             | USD     | Wells Fargo   | 825.292            | 0,26            |
| 6.907                              | USD     | Privia Health Group   | 135.308       | 0,04            | 23.793                             | USD     | Williams  | 927.213            | 0,29            |
| 1.657                              | USD     | Public Service Enterprise Group   | 110.654       | 0,03            | 352                                | USD     | Wingstop  | 128.973            | 0,04            |
| 5.680                              | USD     | QIAGEN  | 244.183       | 0,08            | 37.126                             | USD     | WisdomTree  | 341.188            | 0,11            |
| 279                                | USD     | Regeneron Pharmaceuticals   | 268.535       | 0,08            | 1.246                              | USD     | Workday   | 339.847            | 0,11            |
| 4.677                              | USD     | Revolution Medicines  | 150.740       | 0,05            | 1.572                              | USD     | Zoetis  | 265.998            | 0,08            |
| 4.859                              | USD     | ROBLOX  | 185.517       | 0,06            | 165                                | USD     | Zscaler   | 31.784             | 0,01            |
| 8.629                              | USD     | Rocket Pharmaceuticals  | 232.465       | 0,07            |                                    |         | <b>Summe Aktien</b>   | <b>110.946.800</b> | <b>34,86</b>    |
| 1.862                              | USD     | S&P Global  | 792.188       | 0,25            |                                    |         | <b>Anleihen</b>   |                    |                 |
| 684                                | USD     | Sage Therapeutics   | 12.818        | -               |                                    |         | <b>Frankreich</b>   | <b>169.711</b>     | <b>0,05</b>     |
| 1.751                              | USD     | Schlumberger  | 95.972        | 0,03            | 155.636                            | EUR     | Vallourec 30/06/26, 8,50 %  | 169.711            | 0,05            |
| 6.103                              | USD     | SEACOR Marine Holdings  | 85.076        | 0,03            |                                    |         | <b>Mexiko</b>   | <b>1.531.118</b>   | <b>0,48</b>     |
| 2.169                              | USD     | Semptra   | 155.799       | 0,05            |                                    |         |   |                    |                 |
| 182                                | USD     | ServiceNow  | 138.757       | 0,04            |                                    |         |   |                    |                 |
| 1.361                              | USD     | Shockwave Medical   | 443.182       | 0,14            |                                    |         |   |                    |                 |

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

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

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

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

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

# Anlageportfolio zum 31. März 2024 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

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

# Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2024

## Die Gesellschaft

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

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

## Anteilsklassen

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

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

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

## Ausgabeaufschlag

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

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

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

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

## Vertriebsgebühr

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

## Swing-Pricing

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

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

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

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

## Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

| Teilfonds                             | Anteilsklassen           | Mindestanlage bei Erstzeichnung |             | Mindestanlage bei Folgezeichnungen |            | Mindestanlagebestand |             |
|---------------------------------------|--------------------------|---------------------------------|-------------|------------------------------------|------------|----------------------|-------------|
| Schroder GAIA Asian Equity Long Short | A-, C- und E*-Anteile    | USD                             | 10.000      | USD                                | 5.000      | USD                  | 10.000      |
|                                       | I-Anteile                | USD                             | 5.000.000   | USD                                | 2.500.000  | USD                  | 5.000.000   |
|                                       | IZ- und X1*-Anteile      | USD                             | 100.000.000 | USD                                | 20.000.000 | USD                  | 100.000.000 |
| Schroder GAIA BlueTrend               | A-, C-, E- und N-Anteile | USD                             | 10.000      | USD                                | 5.000      | USD                  | 10.000      |

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

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

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

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

## Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

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

### Nettoinventarwert

#### Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

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

#### Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

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

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

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

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

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

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

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

## Fair Value Pricing

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

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

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

## Besteuerung

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

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

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

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

## Managementgebühren

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

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

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

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

## Managementgebühren (Forts.)

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

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

## Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

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

## Performancegebühren

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

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

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

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

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

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

## Performancegebühren (Forts.)

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

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

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

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

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

## Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

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

## Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

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



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

## Devisenterminkontrakte

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

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

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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



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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

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

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

Die Devisenterminkontrakte bezogen sich auf die folgenden Kontrahenten:

## Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

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

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

## Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

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

## Kassageschäfte

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

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

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

## Kontrahenten von Kassageschäften

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

## Terminkontrakte

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

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

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

## Terminkontrakte (Forts.)

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

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

## Terminkontrakte (Forts.)

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



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

## Terminkontrakte (Forts.)

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

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

## Terminkontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte

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

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

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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



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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

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

## Optionskontrakte (Forts.)

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

## Swaptions

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

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

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

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

## Swaptions (Forts.)

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

## Total Return Swapkontrakte

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

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

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

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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



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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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



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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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



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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

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

## Differenzkontrakte

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

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

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

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

## Differenzkontrakte (Forts.)

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

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

## Differenzkontrakte (Forts.)

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

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

## Differenzkontrakte (Forts.)

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

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

## Differenzkontrakte (Forts.)

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

## Credit Default Index-Swapkontrakte

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

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

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

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

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

## Credit Default Swapkontrakte

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

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

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

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

## Cross-Currency Swapkontrakte

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

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

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

## Inflations-Swapkontrakte

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

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

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

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

## Zins-Swapkontrakte

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

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

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

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

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

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



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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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



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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

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

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

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

## Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

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

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



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

## Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

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

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

## Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für den Berichtszeitraum fielen wie folgt aus:

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

## Dividenden

Während des Berichtszeitraums haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

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

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

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

## Wechselkurs

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

1 Euro = 1,07885 US-Dollar

## Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

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

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

## Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

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

# Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

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

## Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

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

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

# Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

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

## Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

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

# Gesamtkostenquote („TER“)

## für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024

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

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

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

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

| Teilfonds und Anteilklassen                | TER    |
|--|--------|
| <b>Schroder GAIA SEG US Equity</b>         |        |
| Klasse C Thes.                             | 1,42 % |
| Klasse C Thes., in CHF abgesichert         | 1,42 % |
| Klasse C Thes., in EUR abgesichert         | 1,42 % |
| Klasse C Thes., in GBP abgesichert         | 1,42 % |
| Klasse IZ Thes.                            | 1,41 % |
| Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert        | 1,17 % |
| Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert        | 1,43 % |
| Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert        | 1,42 % |
| Klasse K Thes.                             | 2,04 % |
| Klasse K Thes., in CHF abgesichert         | 1,92 % |
| Klasse K Thes., in EUR abgesichert         | 1,92 % |
| Klasse K Thes., in GBP abgesichert         | 1,92 % |
| Klasse R1 Thes.                            | 1,77 % |
| Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert        | 1,77 % |
| Klasse R2 Thes.                            | 1,17 % |
| Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert        | 1,17 % |
| Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert        | 1,17 % |
| Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert        | 1,17 % |
| Klasse R3 Thes.                            | 1,61 % |
| Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert        | 1,42 % |
| Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert        | 1,42 % |
| Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert        | 1,42 % |
| Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert        | 2,33 % |
| Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert        | 1,17 % |
| <b>Schroder GAIA Sirios US Equity</b>      |        |
| Klasse A Thes.                             | 2,43 % |
| Klasse A Thes., in CHF abgesichert         | 2,46 % |
| Klasse A Thes., in EUR abgesichert         | 2,46 % |
| Klasse C Thes.                             | 1,68 % |
| Klasse C Thes., in CHF abgesichert         | 1,71 % |
| Klasse C Thes., in EUR abgesichert         | 1,71 % |
| Klasse C Thes., in GBP abgesichert         | 1,71 % |
| Klasse C Aussch., in GBP abgesichert       | 1,72 % |
| Klasse E Thes.                             | 1,36 % |
| Klasse E Thes., in EUR abgesichert         | 1,41 % |
| Klasse X Thes.                             | 1,52 % |
| Klasse X Thes., in EUR abgesichert         | 1,60 % |
| <b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b> |        |
| Klasse C Thes.                             | 1,81 % |
| Klasse C Thes., in CHF abgesichert         | 1,85 % |
| Klasse C Thes., in EUR abgesichert         | 1,84 % |
| Klasse C Thes., in GBP abgesichert         | 1,83 % |
| Klasse K Thes.                             | 2,33 % |
| Klasse K Thes., in CHF abgesichert         | 2,36 % |
| Klasse K Thes., in EUR abgesichert         | 2,34 % |

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



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

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

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

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäß Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäß Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total-Return-Swaps für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024 nachfolgend detailliert aufgeführt:

## Schroder GAIA Egerton Equity

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

| Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen<br>EUR  | % des verwalteten Vermögens |
|---|-----------------------------|
| 11.922.590  | 2,59 %                      |
| Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen<br>EUR | % des verwalteten Vermögens |
| 7.338.605   | 1,60 %                      |
| Höhe der Vermögenswerte – insgesamt<br>EUR        | % des verwalteten Vermögens |
| 19.261.195  | 4,19 %                      |

### Konzentrationsdaten

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

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

#### Die zehn größten Kontrahenten

| Kontrahent     | Bruttovolumen der offenen Transaktionen<br>EUR |
|----------------|--|
| Morgan Stanley | 7.692.740                                      |
| J.P. Morgan    | 7.275.777                                      |
| Goldman Sachs  | 2.836.062                                      |
| Merrill Lynch  | 1.456.616                                      |
|                | <b>19.261.195</b>                              |

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<br>EUR |
|-----------|------------------|
| Barmittel | 6.959.927        |
|           | <b>6.959.927</b> |

#### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

| Fälligkeit           | Marktwert<br>EUR |
|----------------------|------------------|
| Weniger als 1 Tag    | 6.959.927        |
| 1 bis 7 Tage         | –                |
| 1 bis 4 Wochen       | –                |
| 1 bis 3 Monate       | –                |
| 3 bis 12 Monate      | –                |
| Mehr als 1 Jahr      | –                |
| Unbegrenzte Laufzeit | –                |
|                      | <b>6.959.927</b> |

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

### Währung von Sicherheiten

| Währung | Marktwert<br>EUR |
|---------|------------------|
| EUR     | 6.959.927        |
|         | <b>6.959.927</b> |

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

| Fälligkeit           | Long-Positionen<br>EUR | Short-Positionen<br>EUR | Summe<br>EUR      |
|----------------------|------------------------|-------------------------|-------------------|
| Weniger als 1 Tag    | -                      | -                       | -                 |
| 1 bis 7 Tage         | -                      | -                       | -                 |
| 1 bis 4 Wochen       | -                      | -                       | -                 |
| 1 bis 3 Monate       | -                      | 310.460                 | 310.460           |
| 3 bis 12 Monate      | 10.263.332             | 4.330.485               | 14.593.817        |
| Mehr als 1 Jahr      | 1.659.258              | 2.697.660               | 4.356.918         |
| Unbegrenzte Laufzeit | -                      | -                       | -                 |
|                      | <b>11.922.590</b>      | <b>7.338.605</b>        | <b>19.261.195</b> |

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

### Abrechnung und Clearing

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

### Wiederverwendung von Sicherheiten

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

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

| Verwahrstelle  | Marktwert<br>EUR |
|----------------|------------------|
| Morgan Stanley | 6.959.927        |
|                | <b>6.959.927</b> |

#### 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<br>EUR  |
|----------|-------------------|
| Getrennt | 25.407.336        |
| Gepoolt  | -                 |
| Sonstige | -                 |
|          | <b>25.407.336</b> |

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

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

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

### Rendite und Kosten

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

|                  | Total Return Swaps<br>Absolut – in Teilfondswährung |
|------------------|---|
| An den Teilfonds | 5.901.362   |

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Helix

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

| Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen<br>USD  | % des verwalteten Vermögens |
|---|-----------------------------|
| -   | -                           |
| Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen<br>USD | % des verwalteten Vermögens |
| 6.502.975   | 2,30 %                      |
| Höhe der Vermögenswerte – insgesamt<br>USD        | % des verwalteten Vermögens |
| 6.502.975   | 2,30 %                      |

### Konzentrationsdaten

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

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

#### Die zehn größten Kontrahenten

| Kontrahent     | Bruttovolumen der offenen Transaktionen<br>USD |
|----------------|--|
| Goldman Sachs  | 2.582.217                                      |
| J.P. Morgan    | 2.181.596                                      |
| Morgan Stanley | 1.652.070                                      |
| Barclays Bank  | 87.092   |
|                | <b>6.502.975</b>                               |

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<br>USD |
|-----------|------------------|
| Barmittel | 1.320.000        |
|           | <b>1.320.000</b> |

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

| Fälligkeit           | Marktwert<br>USD |
|----------------------|------------------|
| Weniger als 1 Tag    | 1.320.000        |
| 1 bis 7 Tage         | -                |
| 1 bis 4 Wochen       | -                |
| 1 bis 3<br>Monate    | -                |
| 3 bis 12<br>Monate   | -                |
| Mehr als 1 Jahr      | -                |
| Unbegrenzte Laufzeit | -                |
|                      | <b>1.320.000</b> |

### Währung von Sicherheiten

| Währung | Marktwert<br>USD |
|---------|------------------|
| USD     | 1.320.000        |
|         | <b>1.320.000</b> |

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

| Fälligkeit           | Long-Positionen<br>USD | Short-Positionen<br>USD | Summe<br>USD     |
|----------------------|------------------------|-------------------------|------------------|
| Weniger als 1 Tag    | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 7 Tage         | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 4 Wochen       | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 3 Monate       | -                      | -                       | -                |
| 3 bis 12 Monate      | -                      | 6.502.975               | 6.502.975        |
| Mehr als 1 Jahr      | -                      | -                       | -                |
| Unbegrenzte Laufzeit | -                      | -                       | -                |
|                      | -                      | <b>6.502.975</b>        | <b>6.502.975</b> |

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

### Abrechnung und Clearing

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

### Wiederverwendung von Sicherheiten

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

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

| Verwahrstelle | Marktwert<br>USD |
|---------------|------------------|
| J.P. Morgan   | 1.320.000        |
|               | <b>1.320.000</b> |

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

### Gestellte Sicherheiten

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

| Kontoart | Marktwert<br>USD |
|----------|------------------|
| Getrennt | 2.380.000        |
| Gepoolt  | -                |
| Sonstige | -                |
|          | <b>2.380.000</b> |

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

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

### Rendite und Kosten

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

|                  | Total Return Swaps<br>Absolut – in Teilfondswährung |
|------------------|---|
| An den Teilfonds | <b>60.973.782</b>                                   |

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Sirius US Equity

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

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

### Konzentrationsdaten

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

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

#### Die zehn größten Kontrahenten

| Kontrahent     | Bruttovolumen der offenen Transaktionen<br>USD |
|----------------|--|
| Merrill Lynch  | 3.615.661                                      |
| Goldman Sachs  | 1.437.620                                      |
| Morgan Stanley | 549.750  |
|                | <b>5.603.031</b>                               |

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

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

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

| Art       | Marktwert<br>USD |
|-----------|------------------|
| Barmittel | 100.000          |
|           | <b>100.000</b>   |

#### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

| Fälligkeit           | Marktwert<br>USD |
|----------------------|------------------|
| Weniger als 1 Tag    | 100.000          |
| 1 bis 7 Tage         | -                |
| 1 bis 4 Wochen       | -                |
| 1 bis 3 Monate       | -                |
| 3 bis 12 Monate      | -                |
| Mehr als 1 Jahr      | -                |
| Unbegrenzte Laufzeit | -                |
|                      | <b>100.000</b>   |

#### Währung von Sicherheiten

| Währung | Marktwert<br>USD |
|---------|------------------|
| USD     | 100.000          |
|         | <b>100.000</b>   |

#### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

| Fälligkeit           | Long-Positionen<br>USD | Short-Positionen<br>USD | Summe<br>USD     |
|----------------------|------------------------|-------------------------|------------------|
| Weniger als 1 Tag    | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 7 Tage         | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 4 Wochen       | -                      | 26.132                  | 26.132           |
| 1 bis 3 Monate       | 1.463.983              | 1.153.480               | 2.617.463        |
| 3 bis 12 Monate      | 190.552                | 1.819.835               | 2.010.387        |
| Mehr als 1 Jahr      | 219.756                | 729.293                 | 949.049          |
| Unbegrenzte Laufzeit | -                      | -                       | -                |
|                      | <b>1.874.291</b>       | <b>3.728.740</b>        | <b>5.603.031</b> |

#### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

| Kontrahent     | Land |
|----------------|------|
| Merrill Lynch  | USA  |
| Goldman Sachs  | USA  |
| Morgan Stanley | USA  |

#### Abrechnung und Clearing

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

#### Wiederverwendung von Sicherheiten

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

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

| Verwahrstelle  | Marktwert<br>USD |
|----------------|------------------|
| Morgan Stanley | 100.000          |
|                | <b>100.000</b>   |

#### Gestellte Sicherheiten

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

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

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

### Rendite und Kosten

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

|                  | Total Return Swaps<br>Absolut – in Teilfondswährung |
|------------------|---|
| An den Teilfonds | <b>5.443.133</b>                                    |

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

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

### Konzentrationsdaten

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

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

#### Die zehn größten Kontrahenten

| Kontrahent     | Bruttovolumen der offenen Transaktionen<br>USD |
|----------------|--|
| Morgan Stanley | 4.972.678                                      |
|                | <b>4.972.678</b>                               |

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



# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

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

| Art       | Marktwert<br>USD |
|-----------|------------------|
| Barmittel | 3.359.187        |
|           | <b>3.359.187</b> |

### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

| Fälligkeit           | Marktwert<br>USD |
|----------------------|------------------|
| Weniger als 1 Tag    | 3.359.187        |
| 1 bis 7 Tage         | -                |
| 1 bis 4 Wochen       | -                |
| 1 bis 3 Monate       | -                |
| 3 bis 12 Monate      | -                |
| Mehr als 1 Jahr      | -                |
| Unbegrenzte Laufzeit | -                |
|                      | <b>3.359.187</b> |

### Währung von Sicherheiten

| Währung | Marktwert<br>USD |
|---------|------------------|
| USD     | 3.359.187        |
|         | <b>3.359.187</b> |

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

| Fälligkeit           | Long-Positionen<br>USD | Short-Positionen<br>USD | Summe<br>USD     |
|----------------------|------------------------|-------------------------|------------------|
| Weniger als 1 Tag    | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 7 Tage         | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 4 Wochen       | -                      | -                       | -                |
| 1 bis 3 Monate       | -                      | -                       | -                |
| 3 bis 12 Monate      | 4.972.678              | -                       | 4.972.678        |
| Mehr als 1 Jahr      | -                      | -                       | -                |
| Unbegrenzte Laufzeit | -                      | -                       | -                |
|                      | <b>4.972.678</b>       | <b>-</b>                | <b>4.972.678</b> |

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

| Kontrahent     | Land |
|----------------|------|
| Morgan Stanley | USA  |

### Abrechnung und Clearing

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

### Wiederverwendung von Sicherheiten

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

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

| Verwahrstelle  | Marktwert<br>USD |
|----------------|------------------|
| Morgan Stanley | 3.359.187        |
|                | <b>3.359.187</b> |

#### Gestellte Sicherheiten

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

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

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

#### Rendite und Kosten

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

|                  | Total Return Swaps<br>Absolut – in Teilfondswährung |
|------------------|---|
| An den Teilfonds | <b>46.623.282</b>                                   |

#### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Wellington Pagosa

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

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

### Konzentrationsdaten

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

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

#### Die zehn größten Kontrahenten

| Kontrahent     | Bruttovolumen der offenen Transaktionen<br>USD |
|----------------|--|
| Morgan Stanley | 4.406.913                                      |
| J.P. Morgan    | 2.469.637                                      |
| Goldman Sachs  | 1.215.651                                      |
|                | <b>8.092.201</b>                               |

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

# Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

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

#### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

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

#### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

### Abrechnung und Clearing

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

### Wiederverwendung von Sicherheiten

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

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

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

#### Gestellte Sicherheiten

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

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

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

### Rendite und Kosten

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

|                  | Total Return Swaps<br>Absolut – in Teilfondswährung |
|------------------|---|
| An den Teilfonds | 11.313.977  |

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.



EST. 1804

**Schroder Investment Management (Europe) S.A.**

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

GAIA 31. März 2024 DEAT