



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Informe anual auditado

30 de septiembre de 2021

No se realizarán suscripciones sobre la base de informes periódicos. Las suscripciones son válidas solo si se realizan sobre la base del folleto informativo vigente y los últimos Documentos de datos fundamentales para el inversor, acompañados por el último informe anual auditado disponible o el informe semestral no auditado, en caso de publicarse posteriormente. Este informe se basa en el folleto informativo vigente.

El informe anual auditado, el informe semestral no auditado, el folleto informativo vigente y los Estatutos de la Sociedad están disponibles, de forma gratuita, en el domicilio social de la Sociedad, en 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Gran Ducado de Luxemburgo.

En caso de haber alguna discrepancia entre las versiones traducidas y la versión inglesa de este documento, siempre prevalecerá la versión inglesa.

Índice

Schroder GAIA	5
Consejo de Administración	6
Administración	7
Informe de los Consejeros	9
Informe del Gestor de inversiones	10
Informe de auditoría	12
Balance	15
Cuenta de pérdidas y ganancias	25
Estado de variación patrimonial	27
Distribución sectorial de inversiones	29
Cartera de inversiones	33
Schroder GAIA BlueTrend	33
Schroder GAIA Cat Bond	33
Schroder GAIA Contour Tech Equity	38
Schroder GAIA Egerton Equity	38
Schroder GAIA Helix	39
Schroder GAIA Oaktree Credit*	44
Schroder GAIA Sirios US Equity	48
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	49
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	50
Schroder GAIA Wellington Pagosa	51
Notas a los Estados financieros	62
Ratio de gastos totales ("TER")	143
Anexo I - Información sobre OICVM (sin auditar)	145
Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar)	147
Anexo III - Divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (sin auditar)	158

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

La Sociedad

Schroder GAIA (la "Sociedad") es una sociedad de inversión abierta con responsabilidad limitada y estructura de fondo paraguas. Está organizada como "société anonyme" y cumple los requisitos para ser considerada una "Société d'Investissement à Capital Variable" (SICAV) de conformidad con la Parte I de la Ley de 17 de diciembre de 2010 en su versión vigente. La Sociedad se constituyó el 21 de octubre de 2009 y sus Estatutos se publicaron en el Memorial el 12 de noviembre de 2009 en su versión vigente.

El presente informe abarca el ejercicio comprendido entre el 1 de octubre de 2020 y el 30 de septiembre de 2021. Los estados financieros se preparan de conformidad con los reglamentos luxemburgueses relativos a los organismos de inversión colectiva. La última fecha de cálculo de los precios fue el 30 de septiembre de 2021, último día hábil del ejercicio analizado. En la fecha del presente informe, había disponibles en la Sociedad diez subfondos para la inversión (los "subfondos").

Para obtener información completa sobre los objetivos de inversión de los subfondos, así como sobre los límites de inversión, remítase al folleto informativo vigente. El informe del Gestor de inversiones para cada subfondo puede encontrarse en los informes trimestrales de inversión, los cuales pueden obtenerse en el domicilio social de la Sociedad y en el sitio web de Schroder Investment Management (Europe) S.A. (<http://www.schroders.lu>).

Schroders es una organización que cumple con la Ley estadounidense de cumplimiento tributario de cuentas extranjeras de 2010 (FATCA, por sus siglas en inglés). La clasificación FATCA de esta entidad y su Número de Identificación de Intermediario Global (GIIN, por sus siglas en inglés) son los siguientes: Clasificación de entidades FATCA: Entidad financiera extranjera (FFI, por sus siglas en inglés); Entidad patrocinadora: Schroder Investment Management (Europe) S.A.; GIIN de la Entidad patrocinadora: 4RIMT7.00000.SP.442.

Gobierno corporativo

La Sociedad está sujeta a un gobierno corporativo basado en:

1. Sus obligaciones, tal y como se definen en la Directiva 2009/65/CE de 13 de julio de 2009 relativa a OICVM, según su transposición en el derecho luxemburgués, que está disponible para su consulta en el domicilio social de la Sociedad, en 5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg, Gran Ducado de Luxemburgo.
2. Sus Estatutos, que podrán consultarse en el domicilio social de la Sociedad y en el registro mercantil de Luxemburgo, Registre de Commerce et des Sociétés ("RCSL").
3. Las obligaciones relativas a la gestión de la Sociedad, para la que la Sociedad ha designado a Schroder Investment Management (Europe) S.A. (la "Sociedad Gestora"), la cual está sujeta a los requisitos de la Directiva 2010/43/CE relativa a las sociedades gestoras, según su transposición en el derecho luxemburgués.
4. Los principios del Código de conducta para Fondos de inversión en Luxemburgo de la Asociación Luxemburguesa de Fondos de Inversión ("ALFI"), que la Sociedad ha adoptado voluntariamente.

Sistemas de control interno y de gestión del riesgo

El Consejo de Administración es responsable de establecer y mantener sistemas de control interno y de gestión del riesgo adecuados dentro de la Sociedad en relación con el proceso de información financiera. Dichos sistemas fueron diseñados para gestionar el riesgo de error o fraude en la consecución de los objetivos de información financiera de la Sociedad, más que para eliminarlo, y solamente pueden ofrecer una garantía relativa y no absoluta frente a declaraciones erróneas o pérdidas significativas.

El Consejo de Administración ha acordado con la Sociedad Gestora la puesta en práctica de procedimientos destinados a garantizar que todos los registros contables importantes se lleven de forma adecuada y estén disponibles en cualquier momento, incluida la elaboración de los informes anuales y semestrales. Los informes anuales y semestrales de la Sociedad requieren la aprobación del Consejo de Administración de la Sociedad, y deberán presentarse ante la Commission de Surveillance du Secteur Financier ("CSSF") y, en el caso de los informes anuales, ante el Registre de Commerce et des Sociétés ("RCSL"). Los estados financieros anuales obligatorios deben estar auditados por auditores independientes, quienes informarán al Consejo de Administración sobre sus hallazgos.

El Consejo se reunirá al menos cuatro veces al año y garantizará que la Sociedad mantenga altos estándares de integridad y control en el marco de sus operaciones y disponga de un gobierno corporativo adecuado, así como de los medios de control que requieran las disposiciones legales y normativas.

Consejo de Administración

Presidente

- **Eric Bertrand**

Director de Schroders GAIA

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
FRN 1914
Malta

Otros Consejeros

- **Carla Bergareche**

Directora para España y Portugal

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

- **Mike Champion**

Director de Desarrollo de productos

Schroder Investment Management Limited
1 London Wall Place
Londres EC2Y 5AU
Reino Unido

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Consejera independiente

12, rue de la Sapinière, 8150 Bridel
Gran Ducado de Luxemburgo

- **Bernard Herman**

Consejero independiente

Immeuble Dyapason
4, rue Robert Stumper, 2557 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

- **Achim Kuessner**

Director nacional de Alemania, Austria y Europa central y oriental

Schroder Investment Management (Europe) S.A., German Branch
Taunustor 1 (TaunusTurm), 60310 Fráncfort del Meno
Alemania

- **Hugh Mullan**

Consejero independiente

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo

- **Neil Walton**

Director de Soluciones de inversión

Schroder Investment Management Limited
1 London Wall Place
Londres EC2Y 5AU
Reino Unido

Administración

Domicilio social

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo

Sociedad gestora, Agente de registro y Agente domiciliario

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo

Agente de pagos principal y Agente de transferencias

HSBC Continental Europe, Luxembourg

16, boulevard d'Avranches, 1160 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Depositario y Agente administrativo

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

80, route d'Esch, 1470 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Asesor jurídico principal

Arendt & Medernach S.A.

41A, Avenue J.F. Kennedy, 2082 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Auditor independiente

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Gestores de inversiones

BennBridge Ltd.

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

Contour Asset Management, LLC

99 Park Avenue, Suite 1540, Nueva York NY 10016
Estados Unidos
Schroder GAIA Contour Tech Equity

Egerton Capital (UK) LLP

Stratton House, 5 Stratton Street, Londres W1J 8LA
Reino Unido
Schroder GAIA Egerton Equity

Egerton Capital (UK) LLP ha designado el siguiente Subgestor de inversiones para Schroder GAIA Egerton Equity:

- Egerton Capital (US), LP.

Oaktree Capital Management, L.P.

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

Oaktree Capital Management, L.P. ha designado el siguiente Subgestor de inversiones para Schroder GAIA Oaktree Credit*:

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

1 London Wall Place, Londres EC2Y 5AU
Reino Unido
Schroder GAIA Helix
Schroder GAIA M&A*

Schroder Investment Management Limited ha designado el siguiente Subgestor de inversiones para Schroder GAIA Helix:

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

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Central 2, CH-8001 Zúrich, Suiza
Schroder GAIA Cat Bond

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

Systematica Investments Limited ha designado los siguientes Subgestores de inversiones para Schroder GAIA BlueTrend:

- Systematica Investments UK LLP;
- Systematica Investments Jersey Limited;
- Systematica Investments GP Limited, Geneva branch; y
- Systematica Investments Singapore PTE.

Two Sigma Advisers LP

100 Avenue of the Americas, 16th Floor, Nueva York NY 10013
Estados Unidos
Schroder GAIA Two Sigma Diversified

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remitase al Informe de los Consejeros.

Administración (continuación)

Gestores de inversiones (continuación)

Wellington Management International Limited

Cardinal Place, 80 Victoria Street, Londres SW1E 5JL

Reino Unido

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Wellington Management International Limited ha designado el siguiente Subgestor de inversiones para Schroder GAIA Wellington Pagosa:

- Wellington Management Company LLP.

Informe de los Consejeros

Introducción

Los consejeros de la Sociedad presentan su informe y los estados financieros auditados del ejercicio cerrado a 30 de septiembre de 2021.

Actividades durante el ejercicio

A 30 de septiembre de 2021, el patrimonio neto total de la Sociedad era de 5.674.359.712 EUR frente a los 4.869.786.470 EUR de 30 de septiembre de 2020, lo que representa un aumento del 16,52%.

1. Nuevos Subfondos

Durante el ejercicio analizado, se crearon 2 Subfondos nuevos para la inversión dentro de la Sociedad:

Subfondo	Divisa base del Subfondo	Fecha de lanzamiento
Schroder GAIA M&A	USD	29 de enero de 2021
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	12 de mayo de 2021

2. Nuevas clases de participaciones

Además de las 24 clases de participaciones lanzadas en los Subfondos mencionados anteriormente en las fechas de lanzamiento, también se crearon las siguientes clases de participaciones durante el ejercicio analizado:

Subfondo y clase de participaciones	Divisa de la clase de participaciones	Divisa base del Subfondo	Fecha de lanzamiento
Schroder GAIA BlueTrend			
Clase C Acum. BRL Cubierta	USD	USD	21 de enero de 2021
Clase N Acum. EUR Cubierta	EUR	USD	10 de junio de 2021
Schroder GAIA Cat Bond			
Clase IF Acum. SEK Cubierta	SEK	USD	11 de diciembre de 2020
Clase A Acum. SEK Cubierta	SEK	USD	29 de enero de 2021

3. Liquidación de Subfondos

Durante el ejercicio analizado, se liquidó 1 Subfondo:

Subfondo	Divisa base del Subfondo	Fecha de liquidación
Schroder GAIA M&A	USD	28 de abril de 2021

4. Liquidación de las clases de participaciones

Además de las 12 clases de participaciones del Subfondo liquidado anteriormente mencionado, durante el ejercicio analizado también se liquidó la siguiente clase de participaciones:

Subfondo y clase de participaciones	Divisa de la clase de participaciones	Divisa base del Subfondo	Fecha de liquidación
Schroder GAIA Egerton Equity			
Clase C Acum. JPY Cubierta	JPY	EUR	24 de marzo de 2021

El Consejo de Administración

Schroder GAIA
30 de septiembre de 2021

Informe del Gestor de inversiones

Los subfondos de la gama Schroder GAIA pueden aprovechar las condiciones favorables o desfavorables del mercado mediante exposiciones largas o cortas. En algunas ocasiones, este enfoque puede dar como resultado una rentabilidad muy diversa a corto plazo en relación con los mercados en los que invierten los subfondos.

Análisis económico

Este periodo de doce meses comenzó con un cambio alentador en la pandemia de COVID-19 con el anuncio en noviembre de 2020 del descubrimiento de vacunas eficaces. Otro acontecimiento clave en noviembre fueron las elecciones presidenciales en EE. UU., en las que logró la victoria el candidato demócrata Joe Biden. En la segunda vuelta de las elecciones al Senado en Georgia, en enero, también se produjo la victoria de los demócratas, con lo que el partido consiguió el control de la Casa Blanca, el Senado y la Cámara de Representantes.

La holgada victoria demócrata allanó el camino para un estímulo fiscal considerable. En marzo se aprobó un paquete de ayuda frente al coronavirus de 1,9 billones de dólares estadounidenses, con el objetivo de acelerar la recuperación económica de la crisis provocada por la pandemia.

Junto con las medidas de estímulo, el rápido despliegue de las vacunas contra la COVID-19 en la mayoría de los países desarrollados también permitió que las economías volvieran a abrirse y se recuperaran. Entre las principales economías, Estados Unidos y el Reino Unido lideraron inicialmente las tasas de vacunación, pero Europa y Japón se pusieron al día a finales del verano.

A medida que la demanda se recuperaba en todo el mundo, las cadenas de suministro comenzaron a sufrir una presión cada vez mayor. La escasez de semiconductores se generalizó, obligando a la industria del automóvil a reducir la producción. La alta demanda de mercancías hizo que se disparara el precio de los contenedores de transporte, mientras que la escasez de mano de obra afectó al sector del transporte en gran parte de Europa, siendo el Reino Unido el más afectado. La situación se vio agravada por los brotes de COVID-19 que afectaron a zonas de fabricación y puertos clave en Asia, sobre todo en Vietnam.

Los cuellos de botella en la cadena de suministro contribuyeron a elevar la inflación. La tasa de inflación anual en Estados Unidos superó el 5% en los últimos cinco meses del periodo. Con un crecimiento anualizado del PIB del 6,7% en el segundo trimestre de 2021, la cuestión del endurecimiento de la política monetaria volvió a plantearse. La Reserva Federal de Estados Unidos señaló que empezaría a reducir su programa de compras de activos por valor de 120.000 millones de dólares estadounidenses al mes a finales de año, lo que hizo crecer las expectativas de que los tipos de interés estadounidenses podrían subir en 2022.

Al final del periodo se produjo otro repunte inflacionista en forma de aumento de los precios de la energía. El escaso suministro de gas natural hizo que los precios de la electricidad se dispararan en Europa, mientras que China puso en marcha un racionamiento eléctrico en varias provincias debido a la escasez de carbón.

China estuvo también en el punto de mira debido a los cambios en el panorama regulatorio durante este periodo de doce meses. El sector de la tecnología financiera fue el primero en ser objeto de atención por parte de los reguladores, lo que dio lugar a que la oferta pública inicial prevista de Ant Group se detuviera a finales de 2020. Otros cambios durante el periodo fueron el endurecimiento de la normativa que regula el sector de Internet en general y la transformación de las empresas de tutorías educativas en un sector sin ánimo de lucro.

Análisis del mercado de renta variable

La renta variable mundial repuntó con fuerza en este periodo, y el índice MSCI World obtuvo una rentabilidad del 28,8% (fuente: DataStream). Inicialmente, esta tendencia se vio impulsada por las amplias medidas de apoyo fiscal y monetario, pero también por la noticia, a finales de 2020, de que varias vacunas habían demostrado ser muy eficaces contra la COVID-19.

A continuación, los mercados mundiales de renta variable siguieron avanzando en 2021, apoyados por el éxito obtenido en el despliegue de las vacunas contra la COVID-19 en numerosas partes del mundo y por nuevas medidas de estímulo. Las noticias sobre las vacunas hicieron que los segmentos menos valorados del mercado empezaran a obtener mejores resultados, tras varios años de rendimiento insuficiente. Al final del periodo, el índice MSCI World Value había registrado un avance del 31,7%, frente al 26,1% del índice MSCI World Growth (fuente: DataStream).

A nivel sectorial, la energía fue, con diferencia, el sector más rentable, y el sector financiero (sobre todo el bancario) también obtuvo una rentabilidad muy elevada. Los precios del petróleo cayeron bruscamente durante gran parte de 2020 debido a la baja demanda derivada del bloqueo de las economías. La reapertura económica de 2021 hizo que los precios del petróleo volvieran a subir.

Del mismo modo, el sector financiero ha sido uno de los más débiles de 2020. Los bancos, en particular, se vieron afectados por el temor a posibles insolvencias, y algunos reguladores suspendieron temporalmente las retribuciones a los accionistas para garantizar que los bancos tuvieran suficiente capital para hacer frente a una crisis. Sin embargo, la temida ola de insolvencias no se produjo, por lo que los bancos pudieron reanudar el pago de dividendos y las recompras de activos.

Por otra parte, en el sector de consumo discrecional, el sector del automóvil registró unos rendimientos especialmente sólidos gracias a la fuerte recuperación de la demanda. En el sector de las tecnologías de la información, los valores de los semiconductores obtuvieron una sólida rentabilidad, gracias a la rápida digitalización de la economía mundial que favoreció la demanda.

Entre los sectores menos rentables cabe destacar los considerados seguros, como los servicios públicos y los productos básicos de consumo, en la medida en que los inversores se decantaron por los segmentos del mercado más sensibles al ciclo económico.

La renta variable de los mercados emergentes registró un fuerte avance, pero su rendimiento fue inferior al de los mercados desarrollados. El índice MSCI EM registró un rendimiento del 18,2%. En gran medida, la venta de renta variable china fue la causa de los escasos resultados. Las medidas reguladoras en China fueron el detonante inicial de la debilidad del mercado. Esta situación se vio agravada por la reactivación de algunas restricciones relacionadas con la COVID-19 y la interrupción de la cadena de suministro en agosto, la preocupación por los posibles riesgos sistémicos del sistema financiero derivados de la posible quiebra de la empresa inmobiliaria Evergrande, y la escasez de energía.

En cuanto a otros mercados emergentes, Rusia fue uno de los más rentables debido al aumento de los precios del petróleo y el gas durante el periodo. Taiwán y Corea también registraron buenos avances, gracias a la demanda de semiconductores y otros valores tecnológicos.

La información incluida en este informe es histórica y no es necesariamente indicativa de resultados futuros.

Informe del Gestor de inversiones (continuación)

Análisis del mercado de renta fija

El fuerte repunte económico que siguió a la crisis de la COVID-19 cobró fuerza y apoyó a los mercados, impulsados por las amplias medidas de apoyo fiscal y monetario y, a finales de 2020, por la aparición de las vacunas contra el coronavirus.

La vacunación trajo consigo la promesa de una reapertura económica, que sumada a las expectativas de un gran estímulo fiscal en Estados Unidos impulsó el sentimiento. Este hecho provocó, a su vez, un aumento significativo de las expectativas de crecimiento e inflación y una fuerte subida de los rendimientos del Estado en el primer trimestre de 2021.

A medida que la economía repuntaba con fuerza en 2021 y la demanda reprimida se disparaba con fuerza, se registraron importantes presiones inflacionistas y aumentaron los interrogantes en torno a la posibilidad de que se redujera el apoyo de la política monetaria. La opinión generalizada siempre fue que la inflación sería principalmente transitoria.

En las últimas etapas del periodo, el impulso de la recuperación económica comenzó a disminuir, aunque la presión inflacionista persistió. En septiembre, la Reserva Federal (Fed) y el Banco de Inglaterra (BoE) se volvieron más agresivos.

A lo largo del año, el rendimiento de los bonos estadounidenses a 10 años pasó del 0,69% al 1,49%. Subió cerca de 80 puntos básicos (pb) en el primer trimestre, alcanzando el 1,78%, pero retrocedió desde finales de marzo en vista de los indicios de que el impulso de la recuperación económica se está moderando. Los rendimientos subieron en septiembre como consecuencia del leve giro agresivo de la Fed, que indicaba que la reducción de las compras de activos podría comenzar incluso en noviembre.

El rendimiento de los títulos a 10 años británicos subió del 0,23% al 1,02%. Esta evolución reflejó una rápida mejora de las perspectivas económicas, especialmente en el Reino Unido, donde se consiguieron grandes suministros de vacunas contra la COVID-19 y el rápido despliegue de la vacunación.

Los rendimientos europeos experimentaron una subida menos pronunciada en el primer trimestre, ya que la preocupación por la COVID-19 siguió siendo elevada y la región fue en un primer momento más lenta en el avance de la vacunación. Los rendimientos subieron en abril y mayo cuando el despliegue de las vacunas empezó a avanzar y la recuperación económica se afianzó, pero a continuación retrocedieron. El rendimiento de los títulos a 10 años alemanes subió del -0,52% al -0,19%. El rendimiento de los títulos a 10 años italianos se mantuvo sin cambios en el 0,86%.

Los bonos corporativos registraron rendimientos positivos y superaron a la deuda pública. El espectro de grado de inversión registró un rendimiento total del 1,6% (moneda local) en el año. El alto rendimiento avanzó un 10% (Fuente: ICE Data Indices). El sector energético de alto rendimiento estadounidense experimentó un fuerte repunte, mientras que sectores muy afectados por la COVID-19, como el ocio y el transporte, se recuperaron adecuadamente.

Perspectivas

La reapertura de la economía mundial continúa y la actividad económica ha repuntado sustancialmente. Sin embargo, la fuerza del repunte de la demanda ha cogido a las empresas por sorpresa y las cadenas de suministro se han tensionado, con el consiguiente aumento de la inflación. El equipo de economistas de Schroders sigue esperando una sólida recuperación de la economía mundial, pero, al margen, la previsión se ha movido en dirección a la estanflación a medida que el impulso del crecimiento se desvanece y las presiones sobre los precios aumentan.

La previsión del equipo para el crecimiento mundial es del 5,9% en 2021, y se ralentiza al 4,5% en 2022. La previsión de inflación mundial es del 3,1% en 2021 y del 2,8% en 2022. El equipo prevé una subida de los tipos de interés por parte de la Reserva Federal estadounidense a finales de 2022.

En cuanto a las clases de activos, la renta variable debería contar con el apoyo del sólido crecimiento de los beneficios, que compensará con creces el impacto del aumento de los rendimientos de los bonos. En cuanto a la renta variable, el mercado europeo, excluido el Reino Unido, parece bien situado para beneficiarse de un crecimiento económico relativamente fuerte, ayudado por el éxito de la vacunación, junto con el apoyo monetario del Banco Central Europeo. La naturaleza cíclica del índice de renta variable también hace que esté mejor posicionado para beneficiarse del repunte de la economía mundial. La renta variable estadounidense también debería verse respaldada por los beneficios empresariales, pero las valoraciones son elevadas con respecto a sus datos históricos y a los de sus homólogos.

El panorama de la renta fija parece más complicado. Aunque la intensidad del impulso cíclico ha disminuido, el pico de liquidez mundial parece haber quedado atrás.

Los Gestores de inversiones

Schroder GAIA

Informe de auditoría



Informe de auditoría

Para los Partícipes de
Schroder GAIA

Nuestra opinión

En nuestra opinión, los estados financieros adjuntos reflejan fielmente la situación financiera de Schroder GAIA (el “Fondo”) y de cada uno de sus subfondos a 30 de septiembre de 2021, así como los resultados de sus operaciones y las variaciones de su patrimonio durante el ejercicio cerrado en dicha fecha, de conformidad con los requisitos legales y normativos de Luxemburgo relativos a la elaboración y la presentación de los estados financieros.

Lo que hemos auditado

Los estados financieros del Fondo incluyen:

- el balance a 30 de septiembre de 2021;
- la cuenta de pérdidas y ganancias del ejercicio cerrado a esa fecha;
- el estado de variación patrimonial del ejercicio cerrado a esa fecha;
- la cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021, y
- las notas a los estados financieros, que incluyen un resumen de las políticas contables importantes.

Fundamentos de nuestra opinión

Llevamos a cabo nuestra auditoría en virtud de la Ley de 23 de julio de 2016 relativa a la profesión de auditoría (Ley de 23 de julio de 2016) y de las Normas internacionales de auditoría (ISA, por sus siglas en inglés) adoptadas en Luxemburgo por la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Nuestras responsabilidades según la Ley de 23 de julio de 2016 y las ISA adoptadas en Luxemburgo por la CSSF se describen con más detalle en la sección de “Responsabilidades del ‘Réviseur d’entreprises agréé’ en materia de auditoría de los estados financieros” de nuestro informe.

A nuestro juicio, los elementos probatorios recabados son suficientes y adecuados para fundamentar nuestra opinión.

Somos independientes del Fondo de acuerdo con el Código Internacional de Ética para Profesionales de la Contabilidad (código IESBA, por sus siglas en inglés), así como las Normas Internacionales de Independencia, del Consejo de Normas Internacionales de Ética para Contadores adoptado en Luxemburgo por la CSSF, junto con las otras normas éticas relevantes para la auditoría de los estados financieros. Hemos cumplido nuestras responsabilidades éticas en virtud de estas normas éticas.

Información adicional

El Consejo de Administración del Fondo es responsable de la información adicional. En esta información adicional se declara la información contenida en el informe anual, pero no se incluyen los estados financieros ni el informe de auditoría al respecto.

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

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n° 10028256)
R.C.S. Luxemburgo con el n.º B 65 477 - IVA LU25482518*

Informe de auditoría (continuación)



Nuestra opinión acerca de los estados financieros no cubre la información adicional y no expresamos ninguna conclusión de fiabilidad al respecto.

En relación con nuestra auditoría de los estados financieros, nuestra obligación es leer la información adicional mencionada anteriormente y, al hacerlo, evaluar si la información adicional presenta incoherencias importantes con los estados financieros o nuestros conocimientos adquiridos durante la auditoría, o si contiene otros errores sustanciales. Si, en función del trabajo que realicemos, llegamos a la conclusión de que esta información adicional incluye un error sustancial, estamos obligados a comunicarlo. No tenemos nada que declarar a tal efecto.

Responsabilidades del Consejo de Administración del Fondo con respecto a los estados financieros

El Consejo de Administración del Fondo es responsable de la elaboración y la correcta presentación de los estados financieros de acuerdo con los requisitos legales y normativos de Luxemburgo relativos a la elaboración y la presentación de los estados financieros, y de todos los controles internos que el Consejo de Administración del Fondo determine necesarios para la elaboración de estados financieros que carezcan de anomalías sustanciales, ya sea debido a fraude o error.

Al elaborar los estados financieros, el Consejo de Administración del Fondo es responsable de evaluar la capacidad del Fondo y de cada uno de sus subfondos para seguir siendo una empresa en funcionamiento y comunicará, si corresponde, los problemas para seguir siendo una empresa en funcionamiento y utilizar los principios contables de empresa en funcionamiento, a menos que el Consejo de Administración del Fondo tenga la intención de liquidar el Fondo, cerrar cualquiera de sus subfondos o cesar sus operaciones, o no tenga otra alternativa.

Responsabilidades del “Réviseur d’entreprises agréé” en materia de auditoría de los estados financieros

Los objetivos de nuestra auditoría son obtener garantías razonables acerca de si los estados financieros en su conjunto están libres de errores sustanciales, ya sea debido a fraude o a error, y emitir un informe que incluya nuestra opinión. Una garantía razonable representa un nivel elevado de garantía, aunque no garantiza que una auditoría que se lleve a cabo con arreglo a la Ley de 23 de julio de 2016 y a las Normas ISA adoptadas en Luxemburgo por la CSSF vaya a detectar siempre un error sustancial en caso de haberlo. Los errores pueden deberse a fraude o a equivocación y se consideran sustanciales si, de forma individual o en su conjunto, se espera que puedan influir de manera razonable en las decisiones financieras adoptadas por los usuarios sobre la base de estos estados financieros.

Con arreglo a la Ley de 23 de julio de 2016 y a las Normas ISA adoptadas en Luxemburgo por la CSSF, y como parte de la auditoría, ejercitamos nuestro juicio profesional y mantenemos el escepticismo profesional durante la auditoría. Asimismo:

- identificamos y evaluamos el riesgo de errores sustanciales en los estados financieros, independientemente de si se deben a un fraude o a una equivocación, diseñamos y aplicamos procedimientos para responder a estos riesgos y obtenemos pruebas de auditorías suficientes y adecuadas para expresar nuestra opinión. El riesgo de no detectar un error sustancial que se deba a fraude es superior al de no detectar un error que se deba a una equivocación, ya que el fraude puede implicar colusión, falsificación, omisión deliberada, información falsa o la invalidación de los controles internos;
- adquirimos conocimientos sobre el control interno en la auditoría para diseñar procedimientos de auditoría adaptados a las circunstancias, pero no con la finalidad de expresar una opinión acerca de la eficacia del control interno del Fondo;

Informe de auditoría (continuación)



- evaluamos la adecuación de las políticas contables utilizadas y el sentido común de los cálculos de contabilidad y disposiciones al respecto del Consejo de Administración del Fondo;
- determinamos la adecuación de cómo el Consejo de Administración del Fondo evalúa los aspectos contables relacionados con el principio de empresa en funcionamiento y, en función de las pruebas de auditoría que se obtengan, identificamos si existe una incertidumbre con respecto a los acontecimientos o las situaciones que podrían poner en duda la capacidad del Fondo o de cualquiera de sus subfondos de seguir en funcionamiento. Si llegamos a la conclusión de que existe considerable incertidumbre, debemos incluir en nuestro informe de auditoría las disposiciones pertinentes en los estados financieros o, si dichas disposiciones no son adecuadas, modificar nuestra opinión. Nuestras conclusiones se basan en las pruebas de auditoría obtenidas hasta la fecha de nuestro informe de auditoría. Sin embargo, es posible que los eventos y condiciones del futuro impidan que el Fondo o cualquiera de sus subfondos siga en funcionamiento;
- evaluamos la presentación general, la estructura y el contenido de los estados financieros, incluidas sus disposiciones, y determinar si los estados financieros describen las transacciones y los acontecimientos subyacentes de una forma que permita una presentación justa.

Nos comunicamos con los encargados de la gobernanza en lo relativo, entre otros asuntos, al alcance y a los plazos previstos de la auditoría, así como a las conclusiones significativas de la auditoría, que incluyen las deficiencias relevantes en los controles internos identificadas durante nuestra auditoría.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Representada por

Luxemburgo, 26 de enero de 2022

Karim Bara

Se debe tener en cuenta que el informe de auditoría solo corresponde a la versión de los datos financieros acordados en el contexto de la auditoría legal y presentados ante el organismo regulador de Luxemburgo correspondiente, que se haya firmado a fecha de 26 de enero de 2022.

Balance

a 30 de septiembre de 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ACTIVOS					
Inversiones					
Valores al coste	139.531.492	2.291.292.410	378.600.470	733.799.714	612.348.065
Plusvalía/(minusvalía) latente	7.537.036	(2.063.938)	20.168.614	179.643.229	40.615.192
Valores al valor de mercado	147.068.528	2.289.228.472	398.769.084	913.442.943	652.963.257
Plusvalía/(minusvalía) latente neta					
sobre contratos de divisas a plazo	(2.266.829)	(18.228.179)	(2.589.672)	(12.618.190)	(7.820.668)
sobre operaciones al contado	-	-	-	-	-
sobre contratos de futuros	(813.881)	-	-	3.390.249	3.178.814
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	14.126.360	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tipos de interés	(2.260.994)	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	-	31.558.010	28.015.261
sobre contratos por diferencias	(460.819)	-	13.313.355	-	(19.407.895)
	8.323.837	(18.228.179)	10.723.683	22.330.069	3.965.512
Cuentas por cobrar en valores vendidos	2.241.245	327	5.500.817	4.443.043	30.186.814
Tesorería en bancos	29.765.790	82.076.974	22.306.357	5.620.566	57.752.113
Depósitos a plazo	-	-	-	-	-
Cuenta de margen del agente por cobrar	-	-	-	11.554.168	3.683.959
Garantía por cobrar por garantía pagada	21.323.650	-	20.579.251	17.037.355	2.201.504
Cuentas por cobrar en suscripciones	565.562	7.208.976	1.374.625	298.486	79.901.795
Opciones y swaptions a valor de mercado	-	-	-	-	876.606
Dividendos e intereses por cobrar	642.028	16.826.912	211.689	789.276	5.845.737
Reembolso de fondos por cobrar	96.398	-	-	-	30.883
Garantías por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	1.700.000	16.990.000	2.070.000	-	4.580.000
Ampliaciones de garantía por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	100.000	-	-	1.790.000	-
Otras cuentas por cobrar	-	517.946	-	189.319	-
TOTAL ACTIVOS	211.827.038	2.394.621.428	461.535.506	977.495.225	841.988.180
PASIVOS					
Cuentas por pagar en valores comprados	154.177	7.477.934	6.228.458	7.866.956	98.707.467
Cuentas por pagar en reembolsos	34.116	616.147	1.102.089	5.081.434	947.024
Comisiones de gestión por pagar	194.515	1.881.226	489.056	1.135.403	263.816
Comisiones de rentabilidad por pagar	603.261	-	6.907.142	10.201.533	4.775.314
Dividendos e intereses por pagar	1.222	-	2.476.771	372.273	566.729
Cuenta de margen del agente por pagar	2.574.897	-	-	-	-
Garantía por pagar por garantía recibida	-	3.560.000	-	-	-
Garantías por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	-	-	-	1.780.000	-
Ampliaciones de garantía por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	1.800.000	16.990.000	2.070.000	10.000	4.580.000
Otras cuentas por pagar y devengos	374.510	1.056.596	558.630	1.582.609	614.929
TOTAL PASIVOS	5.736.698	31.581.903	19.832.146	28.030.208	110.455.279
TOTAL PATRIMONIO NETO	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Balance a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Total** EUR
ACTIVOS						
Inversiones						
Valores al coste	28.425.881	273.910.195	245.041.831	28.303.089	296.961.552	4.449.643.415
Plusvalía/(minusvalía) latente	(287.228)	35.636.459	111.036	591.686	16.931.435	282.760.461
Valores al valor de mercado	28.138.653	309.546.654	245.152.867	28.894.775	313.892.987	4.732.403.876
Plusvalía/(minusvalía) latente neta						
sobre contratos de divisas a plazo	139.162	(581.773)	(5.685.407)	57.973	(955.485)	(45.346.414)
sobre operaciones al contado	-	-	12.102	-	-	10.448
sobre contratos de futuros	-	-	(12.295.479)	(25.200)	814.757	(4.508.697)
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	12.784	11.036
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	-	(90.184)	-	6.325	12.122.848
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	(994.921)	(858.912)
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	-	-	-	1.479.884	(674.330)
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	6.648.949	(9.790.394)	-	(485.299)	52.612.542
sobre contratos por diferencias	-	-	-	72.353	-	(5.575.060)
	139.162	6.067.176	(27.849.362)	105.126	(121.955)	7.793.461
Cuentas por cobrar en valores vendidos	117.292	10.707.134	132.671.172	82.509	38.433.497	194.342.015
Tesorería en bancos	715.838	38.821.093	468.653.901	2.273.160	41.471.921	648.454.645
Depósitos a plazo	-	-	161.625.000	-	-	139.530.369
Cuenta de margen del agente por cobrar	-	-	61.157.347	-	12.640.072	78.443.604
Garantía por cobrar por garantía pagada	20.000	-	53.533.522	2.112.021	46.244.509	143.724.605
Cuentas por cobrar en suscripciones	-	161.339	59.999	-	8.110.447	84.368.711
Opciones y swaptions a valor de mercado	-	2.210.525	-	42.642	3.921.620	6.100.235
Dividendos e intereses por cobrar	322.676	125.170	33.898	169.943	1.015.602	22.589.849
Reembolso de fondos por cobrar	-	-	-	-	-	109.881
Garantías por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	40.000	1.080.000	6.840.000	-	1.860.000	30.353.521
Ampliaciones de garantía por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	-	-	500.000	260.000	50.000	2.653.577
Otras cuentas por cobrar	-	-	-	47.350	-	691.538
TOTAL ACTIVOS	29.493.621	368.719.091	1.102.378.344	33.987.526	467.518.700	6.091.559.887
PASIVOS						
Cuentas por pagar en valores comprados	779.352	15.921.991	181.356.124	312.477	44.763.340	315.036.534
Cuentas por pagar en reembolsos	-	2.416.710	724.666	76.485	111.590	10.309.041
Comisiones de gestión por pagar	4.094	454.860	1.176.199	20.032	418.465	5.373.519
Comisiones de rentabilidad por pagar	-	1.737.458	-	1.035.559	7.568.768	30.046.360
Dividendos e intereses por pagar	-	699.521	628.142	49.568	690.316	4.800.545
Cuenta de margen del agente por pagar	-	-	-	-	-	2.222.901
Garantía por pagar por garantía recibida	-	7.310.000	-	-	-	9.384.038
Garantías por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	-	-	-	180.000	-	1.989.377
Ampliaciones de garantía por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	40.000	1.080.000	7.340.000	80.000	1.910.000	31.017.720
Otras cuentas por pagar y devengos	43.264	475.951	2.764.383	24.919	376.725	7.020.140
TOTAL PASIVOS	866.710	30.096.491	193.989.514	1.779.040	55.839.204	417.200.175
TOTAL PATRIMONIO NETO	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496	5.674.359.712

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

** Para la totalidad del Balance, que se ha presentado en euros, el activo y el pasivo expresados en divisas distintas del euro se han convertido según los siguientes tipos de cambio, a 30 de septiembre de 2021: 1 euro = 1,15835 dólares estadounidenses y 1 euro = 0,85969 libras esterlinas.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Valor liquidativo					
a 30 de septiembre de 2021	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901
a 30 de septiembre de 2020	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534
a 30 de septiembre de 2019	90.737.733	1.338.107.686	149.869.826	1.024.540.653	235.393.291
Participaciones en circulación**					
a 30 de septiembre de 2021					
Clase A Acum.	32.279	1.163	265.966	462.817	18.480
Clase A Acum. CHF Cubierta	100	-	4.120	-	511
Clase A Acum. EUR Cubierta	447.014	-	57.496	-	108.579
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	11.365	-
Clase A Acum. SEK Cubierta	-	100	-	-	-
Clase A Acum. SGD Cubierta	100	-	5.342	-	140
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	396.027	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	900	-
Clase A1 Acum.	-	-	29.302	24.009	-
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	106.081	-
Clase A2 Acum.	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Acum.	301.153	2.620	1.438.659	1.661.214	12.370
Clase C Acum. BRL Cubierta	246.989	-	-	-	-
Clase C Acum. CHF Cubierta	4.082	1.327	31.429	-	100
Clase C Acum. EUR Cubierta	163.803	7.138	831.869	-	358.638
Clase C Acum. GBP Cubierta	364.609	100	227.640	199.707	155.284
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	99.123	-	-
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	100	-	140
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	-	1.031.573	-
Clase C Dist.	-	-	-	5.802	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	9.767	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	185	-	-	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	-	-	1
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	2
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	2
Clase E Acum.	84.090	-	23.447	1.475	525.100
Clase E Acum. CHF	19	-	-	-	-
Clase E Acum. CHF Cubierta	128	-	2.569	-	52.001
Clase E Acum. EUR Cubierta	5.000	-	54.362	-	998.676
Clase E Acum. GBP	18	-	-	-	-
Clase E Acum. GBP Cubierta	90	-	45.921	-	980.906
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	51.068	-	-
Clase E Acum. SGD Cubierta	-	-	100	-	140
Clase E Dist. GBP Cubierta	120.006	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	16.638	-	-	-
Clase F Acum. CHF Cubierta	-	3.133	-	-	-
Clase F Acum. EUR Cubierta	-	12.488	-	-	-
Clase F Dist.	-	162	-	-	-
Clase F Dist. SGD Cubierta	-	477	-	-	-
Clase I Acum.	15	152.255	15	14	1.564.534
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	26.914	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	9	-	-	-
Clase I Acum. JPY Cubierta	-	120	-	-	103
Clase I Acum. USD Cubierta	-	-	-	65	-
Clase IF Acum.	-	211.956	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	133.658	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	486.592	-	-	-
Clase IF Acum. SEK Cubierta	-	6.766.334	-	-	-
Clase IF Dist.	-	18.374	-	-	-
Clase K Acum.	-	-	-	-	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase K Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase N Acum. EUR Cubierta	100	-	-	-	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	1.250	-	-	-	-
Clase R Acum.	-	-	-	-	-
Clase R Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase R Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase X Acum.	-	-	-	356.400	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	653.632

** Consulte las normas de denominación de las clases de participaciones en el apartado "Clases de Participaciones" de las Notas a los Estados financieros.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Valor liquidativo					
a 30 de septiembre de 2021	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496
a 30 de septiembre de 2020	-	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372
a 30 de septiembre de 2019	-	771.660.956	1.796.666.842	63.415.401	488.290.256
Participaciones en circulación**					
a 30 de septiembre de 2021					
Clase A Acum.	-	730.032	-	-	117.707
Clase A Acum. CHF Cubierta	-	6.620	-	-	2.033
Clase A Acum. EUR Cubierta	-	207.134	-	-	101.646
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	17.350
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	-	-
Clase A1 Acum.	-	-	-	-	15
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum.	15	-	-	-	-
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	100	-	-	-	-
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	100	-	-	-	-
Clase C Acum.	15	676.508	2.757.595	4.001	1.800.594
Clase C Acum. BRL Cubierta	-	-	-	-	179.227
Clase C Acum. CHF Cubierta	100	13.864	28.110	1.455	27.313
Clase C Acum. EUR Cubierta	100	380.105	1.696.979	113.010	553.031
Clase C Acum. GBP Cubierta	100	62.573	1.942.370	-	447.967
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	96
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	-	12.192	-
Clase C Dist.	-	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	-	3.104	-	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	-	-	1
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	6
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	331
Clase E Acum.	42.522	894	-	-	51.725
Clase E Acum. CHF	-	-	-	-	-
Clase E Acum. CHF Cubierta	15.582	-	-	-	10.867
Clase E Acum. EUR Cubierta	18.534	24.191	-	-	149.840
Clase E Acum. GBP	-	-	-	-	-
Clase E Acum. GBP Cubierta	100	-	-	-	69.518
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase E Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	96
Clase E Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	-	-	-	-
Clase F Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase F Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase F Dist.	-	-	-	-	-
Clase F Dist. SGD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum.	200.015	15	15	15	15
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum. JPY Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum.	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Dist.	-	-	-	-	-
Clase K Acum.	-	-	759.943	-	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	-	2.734	-	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	-	79.709	304	-
Clase K Acum. USD Cubierta	-	-	-	77	-
Clase N Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase R Acum.	-	-	-	115.671	-
Clase R Acum. EUR Cubierta	-	-	-	27.408	-
Clase R Acum. USD Cubierta	-	-	-	7.597	-
Clase X Acum.	-	15	-	-	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	20.218	-	-	-

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

** Consulte las normas de denominación de las clases de participaciones en el apartado "Clases de Participaciones" de las Notas a los Estados financieros.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

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

** El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

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

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

** El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

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

** El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

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

** El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Valor liquidativo por Participación**					
a 30 de septiembre de 2019					
Clase A Acum.	90,19	1.343,87	98,08	192,44	99,44
Clase A Acum. CHF Cubierta	81,10	-	93,34	-	96,39
Clase A Acum. EUR Cubierta	83,43	-	93,49	-	96,73
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	179,02	-
Clase A Acum. SGD Cubierta	123,65	-	137,19	-	98,58
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	185,96	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	189,83	-
Clase A1 Acum.	-	-	98,54	182,12	-
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	180,78	-
Clase C Acum.	91,67	1.343,89	99,97	204,59	99,96
Clase C Acum. CHF Cubierta	82,83	-	95,24	-	97,25
Clase C Acum. EUR Cubierta	84,25	-	95,20	-	97,58
Clase C Acum. GBP Cubierta	88,21	-	78,01	188,52	98,52
Clase C Acum. JPY Cubierta	-	-	-	26.296,37	-
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	782,57	-	-
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	139,16	-	99,45
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	-	196,82	-
Clase C Dist.	-	-	-	204,38	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	202,06	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	88,61	-	-	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	100,82	-	4.896,70
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	95,35	-	4.862,29
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	95,34	-	4.879,79
Clase E Acum.	94,51	-	100,74	203,46	100,27
Clase E Acum. CHF	88,76	-	-	-	-
Clase E Acum. CHF Cubierta	84,18	-	95,56	-	97,52
Clase E Acum. EUR Cubierta	86,46	-	95,98	-	97,95
Clase E Acum. GBP	102,29	-	-	-	-
Clase E Acum. GBP Cubierta	91,87	-	77,78	-	98,81
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	785,09	-	-
Clase E Acum. SGD Cubierta	-	-	139,72	-	99,61
Clase E Dist. GBP Cubierta	91,25	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	1.344,00	-	-	-
Clase F Acum. CHF Cubierta	-	1.094,39	-	-	-
Clase F Acum. EUR Cubierta	-	1.143,68	-	-	-
Clase F Dist.	-	1.157,07	-	-	-
Clase F Dist. SGD Cubierta	-	1.555,75	-	-	-
Clase I Acum.	100,54	1.476,61	105,40	276,20	99,36
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	1.291,72	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	1.354,51	-	-	-
Clase I Acum. USD Cubierta	-	-	-	217,03	-
Clase IF Acum.	-	1.376,55	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	1.203,99	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	1.262,49	-	-	-
Clase IF Dist.	-	1.376,52	-	-	-
Clase K Acum.	-	-	-	-	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase K Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	90,97	-	-	-	-
Clase R Acum.	-	-	-	-	-
Clase R Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase R Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	97,60

** El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Balance

a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Valor liquidativo por Participación**				
a 30 de septiembre de 2019				
Clase A Acum.	146,28	-	-	101,02
Clase A Acum. CHF Cubierta	180,04	-	-	95,72
Clase A Acum. EUR Cubierta	135,14	-	-	96,38
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-
Clase A Acum. SGD Cubierta	-	-	-	139,72
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	-
Clase A1 Acum.	-	-	-	100,16
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	-
Clase C Acum.	150,94	127,22	100,92	102,25
Clase C Acum. CHF Cubierta	183,52	118,41	129,30	96,86
Clase C Acum. EUR Cubierta	139,08	120,03	114,72	97,55
Clase C Acum. GBP Cubierta	143,50	122,85	-	79,51
Clase C Acum. JPY Cubierta	-	-	-	-
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	-	141,47
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	133,02	-
Clase C Dist.	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	143,44	-	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	-	5.115,13
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	4.846,62
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	4.877,98
Clase E Acum.	160,53	-	-	102,99
Clase E Acum. CHF	-	-	-	-
Clase E Acum. CHF Cubierta	-	-	-	97,61
Clase E Acum. EUR Cubierta	148,43	-	-	98,30
Clase E Acum. GBP	-	-	-	-
Clase E Acum. GBP Cubierta	-	-	-	80,14
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-
Clase E Acum. SGD Cubierta	-	-	-	142,59
Clase E Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	-	-	-
Clase F Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-
Clase F Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-
Clase F Dist.	-	-	-	-
Clase F Dist. SGD Cubierta	-	-	-	-
Clase I Acum.	188,48	143,26	102,17	104,76
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-
Clase I Acum. USD Cubierta	-	-	-	-
Clase IF Acum.	-	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-
Clase IF Dist.	-	-	-	-
Clase K Acum.	-	125,56	-	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	116,85	-	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	118,25	114,20	-
Clase K Acum. USD Cubierta	-	-	131,91	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-
Clase R Acum.	-	-	100,92	-
Clase R Acum. EUR Cubierta	-	-	114,72	-
Clase R Acum. USD Cubierta	-	-	133,03	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-

** El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Cuenta de pérdidas y ganancias del ejercicio cerrado a 30 de septiembre de 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA M&A* USD
INGRESOS						
Dividendos netos [^]	-	-	-	4.366.120	23.153.030	153.979
Intereses sobre bonos	1.742.100	96.249.784	-	-	293.881	-
Ingresos netos sobre swaps	2.669.699	-	-	-	-	-
Intereses bancarios	80	274	15.201	-	-	39
Otros ingresos	51.782	344.159	-	146.141	21.535	-
Total Ingresos	4.463.661	96.594.217	15.201	4.512.261	23.468.446	154.018
GASTOS						
Comisiones de rentabilidad	603.261	-	6.907.142	11.313.283	4.775.335	-
Comisiones de gestión	1.691.229	19.244.661	5.137.569	13.982.315	2.052.236	201
Gastos de dividendos netos [^]	-	-	4.471.280	-	-	-
Gastos netos sobre swaps	-	-	2.384.228	2.381.948	1.531.065	4.655
Comisiones del depositario	85.407	505.549	100.679	256.714	142.934	641
Comisiones de administración	469.191	3.058.843	1.234.118	3.115.141	560.607	1.410
Taxe d'abonnement	80.549	76.806	205.859	467.871	146.949	189
Comisiones de distribución	-	-	22.011	109.818	-	-
Amortización de los gastos de constitución	3.770	-	-	-	-	-
Gastos de liquidación	-	-	-	-	-	5.000
Gastos bancarios y de intereses	49.639	22.551	518	375.284	85.888	-
Otros gastos	90.092	755.009	207.879	2.803.299	215.046	377
Total Gastos	3.073.138	23.663.419	20.671.283	34.805.673	9.510.060	12.473
Menos: Subsidio de gastos	(96.398)	-	-	-	(30.883)	-
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN	1.486.921	72.930.798	(20.656.082)	(30.293.412)	13.989.269	141.545

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

[^] Incluye dividendos recibidos/pagados vinculados a derivados con renta variable subyacente.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cuenta de pérdidas y ganancias del ejercicio cerrado a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Total** EUR
INGRESOS						
Dividendos netos [^]	-	2.086.865	500	611.459	1.374.666	28.187.003
Intereses sobre bonos	456.043	570.769	112.494	285.615	3.569.443	89.247.079
Ingresos netos sobre swaps	-	-	-	-	-	2.304.743
Intereses bancarios	-	-	-	-	-	13.462
Otros ingresos	-	59.815	-	-	17.975	573.703
Total Ingresos	456.043	2.717.449	112.994	897.074	4.962.084	120.325.990
GASTOS						
Comisiones de rentabilidad	-	1.737.457	-	1.035.559	7.568.768	31.158.127
Comisiones de gestión	20.528	6.597.639	16.552.291	314.526	5.786.609	63.627.721
Gastos de dividendos netos [^]	-	-	-	-	-	3.860.042
Gastos netos sobre swaps	-	3.426.917	10.771.954	319.558	4.041.573	21.884.659
Comisiones del depositario	5.250	112.296	300.827	11.770	282.669	1.596.646
Comisiones de administración	11.432	1.352.233	3.554.521	103.287	1.454.534	13.333.175
Taxe d'abonnement	2.976	195.446	528.688	18.597	218.367	1.746.316
Comisiones de distribución	-	-	-	-	8	128.827
Amortización de los gastos de constitución	-	-	-	-	-	3.255
Gastos de liquidación	-	-	-	-	-	4.316
Gastos bancarios y de intereses	9.120	15.384	474.192	3.816	44.066	985.203
Otros gastos	3.215	201.203	615.131	21.158	244.574	4.841.572
Total Gastos	52.521	13.638.575	32.797.604	1.828.271	19.641.168	143.169.859
Menos: Subsidio de gastos	-	-	-	-	-	(109.881)
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN	403.522	(10.921.126)	(32.684.610)	(931.197)	(14.679.084)	(22.733.988)

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

** En toda la Cuenta de pérdidas y ganancias, que se ha presentado en euros, el activo y el pasivo expresados en divisas distintas del euro se han convertido según los siguientes tipos de cambio, a 30 de septiembre de 2021: 1 euro = 1,15835 dólares estadounidenses y 1 euro = 0,85969 libras esterlinas.

[^] Incluye dividendos recibidos/pagados vinculados a derivados con renta variable subyacente.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Estado de variación patrimonial del ejercicio cerrado a 30 de septiembre de 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA M&A* USD
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN***	1.486.921	72.930.798	(20.656.082)	(30.293.412)	13.989.269	141.545
Ganancias/(pérdidas) netas materializadas						
sobre valores vendidos	11.114.653	(11.047.681)	82.597.574	207.454.760	39.799.815	47.573
sobre contratos de divisas a plazo	72.803	(19.283.441)	(974.631)	(8.498.080)	(3.576.734)	13.606
sobre operaciones al contado	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de futuros	2.382.866	-	(647)	(7.800.921)	(24.982.403)	(11.166)
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	(13.096.949)	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tipos de interés	(2.258.972)	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	-	(111.793.002)	(152.813.857)	-
sobre contratos por diferencias	-	-	(40.266.795)	-	139.736.286	(176.729)
sobre contratos de opciones y swaptions	1.053.774	-	2.677.205	(411.172)	(5.564.650)	(8.910)
sobre divisas	240.206	(111.717)	(214.218)	(20.454.627)	1.778.417	(12.385)
Ganancias/(pérdidas) netas materializadas	(491.619)	(30.442.839)	43.818.488	58.496.958	(5.623.126)	(148.011)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente						
sobre inversiones	13.248.576	9.057.644	(14.628.238)	15.173.190	33.163.387	-
sobre contratos de divisas a plazo	(1.642.938)	(18.774.512)	(3.082.044)	(6.974.078)	(7.566.062)	-
sobre operaciones al contado	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de futuros	(1.642.279)	-	-	3.390.249	2.338.052	-
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	12.609.083	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tipos de interés	(1.374.617)	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	-	17.598.082	20.789.295	-
sobre contratos por diferencias	(372.928)	-	11.064.631	-	(17.532.685)	-
sobre contratos de opciones y swaptions	4.470	-	(154.283)	231.486	554.788	-
sobre divisas	15.041	(524.382)	(6.086)	(32.147)	(201.791)	-
VARIACIÓN NETA DE LA PLUSVALÍA/(MINUSVALÍA) LATENTE	20.844.408	(10.241.250)	(6.806.020)	29.386.782	31.544.984	-
VARIACIÓN NETA EN EL PATRIMONIO NETO TOTAL COMO RESULTADO DE LAS OPERACIONES	21.839.710	32.246.709	16.356.386	57.590.328	39.911.127	(6.466)
Beneficios netos de la emisión de participaciones	121.045.445	1.275.227.015	321.321.585	195.745.576	401.820.548	6.968.914
Pago por participaciones reembolsadas	(24.598.564)	(187.199.294)	(125.270.061)	(319.324.692)	(114.387.308)	(6.962.448)
Distribución de los ingresos netos de inversión	(134.177)	(677.713)	-	-	-	-
Incremento/(descenso) del patrimonio neto durante el ejercicio	118.152.414	1.119.596.717	212.407.910	(65.988.788)	327.344.367	-
Patrimonio neto al inicio del ejercicio	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534	-
Ajuste de divisa teórico****	-	-	-	-	-	-
PATRIMONIO NETO AL CIERRE DEL EJERCICIO	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901	-

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

*** Consulte la Cuenta de pérdidas y ganancias para conocer el cálculo de los Ingresos/(pérdidas) netos de inversión.

**** Este ajuste refleja la diferencia entre el balance de apertura usando el tipo de cambio a 30 de septiembre de 2020 y el mismo patrimonio neto con el tipo de cambio a 30 de septiembre de 2021.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Estado de variación patrimonial del ejercicio cerrado a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Total** EUR
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN***	403.522	(10.921.126)	(32.684.610)	(931.197)	(14.679.084)	(22.733.988)
Ganancias/(pérdidas) netas materializadas						
sobre valores vendidos	19.177	142.412.291	1.007.099	90.966	73.301.173	500.435.507
sobre contratos de divisas a plazo	1.301	(477.182)	12.902.895	(1.898.662)	16.381.351	(6.338.361)
sobre operaciones al contado	-	-	669.271	-	-	577.780
sobre contratos de futuros	-	(287)	66.578.918	(559.911)	(2.161.644)	27.638.466
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	(981.438)	(847.272)
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	-	350.935	-	(1.102.403)	(11.955.296)
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	(474.316)	(409.476)
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	-	-	-	1.704.914	(478.317)
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	(67.473.343)	(47.244.778)	-	(22.741.061)	(362.384.830)
sobre contratos por diferencias	-	-	-	1.680.774	-	87.674.225
sobre contratos de opciones y swaptions	-	4.227	-	(250.554)	(7.815.929)	(9.037.131)
sobre divisas	19.719	2.194.510	(223.369)	2.706	4.760.699	(13.172.279)
Ganancias/(pérdidas) netas materializadas	40.197	76.660.216	34.040.971	(934.681)	60.871.346	211.703.016
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente						
sobre inversiones	(287.228)	(14.097.149)	(214.919)	8.077.212	7.430.348	53.637.952
sobre contratos de divisas a plazo	139.162	(1.494.278)	(13.645.150)	465.904	(6.637.046)	(51.930.360)
sobre operaciones al contado	-	-	15.896	-	-	13.723
sobre contratos de futuros	-	-	(13.224.263)	(6.110)	1.061.137	(6.516.589)
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	(508.473)	(438.963)
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	-	(215.884)	-	179.878	10.854.299
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	836.784	722.393
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	-	-	-	1.900.608	454.086
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	3.546.270	(5.943.202)	-	(3.350.576)	30.583.611
sobre contratos por diferencias	-	-	-	156.667	-	(5.723.563)
sobre contratos de opciones y swaptions	-	421.626	-	(5.889)	(84.632)	865.175
sobre divisas	(1.184)	10.348	(410.831)	440	(356.608)	(1.305.424)
VARIACIÓN NETA DE LA PLUSVALÍA/(MINUSVALÍA) LATENTE	(149.250)	(11.613.183)	(33.638.353)	8.688.224	471.420	31.216.340
VARIACIÓN NETA EN EL PATRIMONIO NETO TOTAL COMO RESULTADO DE LAS OPERACIONES	294.469	54.125.907	(32.281.992)	6.822.346	46.663.682	220.185.368
Beneficios netos de la emisión de participaciones	28.332.442	85.423.397	225.846.496	1.797.424	109.590.621	2.421.323.644
Pago por participaciones reembolsadas	-	(297.355.833)	(722.315.237)	(29.643.727)	(296.465.179)	(1.885.773.445)
Distribución de los ingresos netos de inversión	-	-	-	-	-	(700.902)
Incremento/(descenso) del patrimonio neto durante el ejercicio	28.626.911	(157.806.529)	(528.750.733)	(21.023.957)	(140.210.876)	755.034.665
Patrimonio neto al inicio del ejercicio	-	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372	4.869.786.470
Ajuste de divisa teórico****	-	-	-	-	-	49.538.577
PATRIMONIO NETO AL CIERRE DEL EJERCICIO	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496	5.674.359.712

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

** En todo el Estado de variación patrimonial, que se ha presentado en euros, el activo y el pasivo expresados en divisas distintas del euro se han convertido según los siguientes tipos de cambio, a 30 de septiembre de 2021: 1 euro = 1,15835 dólares estadounidenses y 1 euro = 0,85969 libras esterlinas.

*** Consulte la Cuenta de pérdidas y ganancias para conocer el cálculo de los Ingresos/(pérdidas) netos de inversión.

**** Este ajuste refleja la diferencia entre el balance de apertura usando el tipo de cambio a 30 de septiembre de 2020 y el mismo patrimonio neto con el tipo de cambio a 30 de septiembre de 2021.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Distribución sectorial de inversiones

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Renta fija, instrumentos negociables y valores respaldados por activos e hipotecas	71,36	94,52	-	-	17,64
Otros valores					
Industria aeroespacial y defensa	-	-	-	-	-
Agricultura	-	-	-	-	-
Líneas aéreas	-	-	-	-	-
Ropa	-	-	-	1,16	0,48
Fabricantes de automóviles	-	-	-	-	1,17
Piezas y equipamiento de automóviles	-	-	-	-	0,07
Bancos	-	-	-	1,90	11,84
Bebidas	-	-	-	-	0,68
Biotecnología	-	-	-	-	0,15
Materiales de construcción	-	-	-	0,49	0,03
Productos químicos	-	-	-	5,44	1,59
Carbón	-	-	-	-	-
Servicios comerciales	-	-	7,43	2,08	0,47
Informática	-	-	7,70	-	0,95
Cosméticos y cuidado personal	-	-	-	-	0,25
Distribución y venta mayorista	-	-	-	-	0,92
Servicios financieros diversificados	-	-	-	11,52	3,37
Eléctrico	-	-	-	-	0,01
Componentes e instrumentos eléctricos	-	-	-	-	0,84
Electrónica	-	-	-	-	2,06
Fuentes alternativas de energía	-	-	-	-	0,61
Ingeniería y construcción	-	-	-	-	-
Entretenimiento	-	-	-	-	-
Control medioambiental	-	-	-	-	0,12
Alimentos	-	-	-	-	2,02
Productos forestales y papel	-	-	-	-	-
Gas	-	-	-	-	0,01
Salud (productos)	-	-	-	-	0,44
Salud (servicios)	-	-	-	3,62	0,80
Sociedades de control (diversificado)	-	-	-	-	-
Constructores de viviendas	-	-	-	3,26	0,06
Mobiliario del hogar	-	-	-	-	1,31
Utensilios del hogar	-	-	-	-	0,42
Seguros	-	2,36	-	-	0,49
Internet	-	-	18,37	19,97	1,97
Sociedades de inversión	-	-	-	1,77	4,52
Hierro y acero	-	-	-	-	0,64
Tiempo libre	-	-	-	-	0,34
Maquinaria (construcción y minería)	-	-	-	-	0,35
Maquinaria (diversificado)	-	-	-	-	0,52
Medios de comunicación	-	-	9,68	10,90	-
Metalurgia	-	-	-	-	-
Minería	-	-	-	-	1,11
Fabricación diversa	-	-	-	-	0,35

Distribución sectorial de inversiones (continuación)

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Otros valores (continuación)					
Equipamiento de oficina y empresarial	-	-	1,05	-	-
Petróleo y gas	-	-	-	-	7,13
Servicios de petróleo y gas	-	-	-	-	-
Embalaje y contenedores	-	-	-	-	-
Productos farmacéuticos	-	-	-	0,42	1,52
Tuberías	-	-	-	-	-
Sector inmobiliario	-	-	8,53	0,48	0,17
Ventas minoristas	-	-	-	5,18	4,04
Ahorros y préstamos	-	-	-	-	-
Semiconductores	-	-	9,99	5,35	15,68
Software	-	-	27,53	5,00	1,38
Almacenamiento y depósito	-	-	-	-	-
Telecomunicaciones	-	-	-	0,73	0,67
Juguetes, juegos y aficiones	-	-	-	-	-
Transporte	-	-	-	16,94	0,07
Agua	-	-	-	-	-
Cartera de inversiones como porcentaje del patrimonio neto	71,36	96,88	90,28	96,21	89,26
Depósitos a plazo	-	-	-	-	-
Otros activos netos	28,64	3,12	9,72	3,79	10,74
Total Patrimonio neto	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Distribución sectorial de inversiones (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Renta fija, instrumentos negociables y valores respaldados por activos e hipotecas	98,29	0,78	26,44	58,88	38,39
Otros valores					
Industria aeroespacial y defensa	-	0,98	-	-	0,05
Agricultura	-	0,27	-	-	-
Líneas aéreas	-	2,68	-	-	-
Ropa	-	0,98	-	-	-
Fabricantes de automóviles	-	1,50	-	-	0,41
Piezas y equipamiento de automóviles	-	1,78	-	-	0,04
Bancos	-	5,22	-	-	6,45
Bebidas	-	3,97	-	1,48	0,08
Biotecnología	-	-	-	-	2,87
Materiales de construcción	-	3,18	-	-	0,49
Productos químicos	-	1,23	-	-	0,32
Carbón	-	-	-	-	0,09
Servicios comerciales	-	6,82	-	4,11	1,95
Informática	-	0,90	-	0,58	0,26
Cosméticos y cuidado personal	-	-	-	-	-
Distribución y venta mayorista	-	-	-	-	0,18
Servicios financieros diversificados	-	6,92	-	1,17	1,42
Eléctrico	-	-	-	-	1,86
Componentes e instrumentos eléctricos	-	-	-	-	0,34
Electrónica	-	0,60	-	1,63	0,16
Fuentes alternativas de energía	-	-	-	-	0,46
Ingeniería y construcción	-	4,47	-	-	0,50
Entretenimiento	-	-	-	1,86	0,02
Control medioambiental	-	0,82	-	-	0,06
Alimentos	-	0,15	-	-	-
Productos forestales y papel	-	-	-	-	0,07
Gas	-	-	-	-	0,22
Salud (productos)	-	8,72	-	1,57	1,48
Salud (servicios)	-	-	-	-	0,41
Sociedades de control (diversificado)	-	-	-	-	0,48
Constructores de viviendas	-	1,39	-	-	0,43
Mobiliario del hogar	-	-	-	-	0,11
Utensilios del hogar	-	-	-	2,14	-
Seguros	-	-	-	-	2,93
Internet	-	4,18	-	-	0,52
Sociedades de inversión	-	-	0,55	2,99	0,57
Hierro y acero	-	-	-	-	0,32
Tiempo libre	-	3,53	-	1,23	0,11
Maquinaria (construcción y minería)	-	-	-	-	0,15
Maquinaria (diversificado)	-	-	-	1,06	0,51
Medios de comunicación	-	1,22	-	-	-
Metalurgia	-	-	-	-	0,19
Minería	-	-	-	-	0,70

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Distribución sectorial de inversiones (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit* %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Otros valores (continuación)					
Fabricación diversa	-	-	-	3,05	0,42
Equipamiento de oficina y empresarial	-	-	-	-	-
Petróleo y gas	-	0,15	-	-	6,45
Servicios de petróleo y gas	-	2,38	-	-	0,09
Embalaje y contenedores	-	1,10	-	-	-
Productos farmacéuticos	-	2,52	-	-	1,21
Tuberías	-	-	-	-	0,68
Sector inmobiliario	-	0,38	-	1,27	0,36
Ventas minoristas	-	7,77	-	3,32	0,16
Ahorros y préstamos	-	-	-	-	0,04
Semiconductores	-	3,14	-	-	0,35
Software	-	7,53	-	1,40	0,37
Almacenamiento y depósito	-	-	-	1,97	-
Telecomunicaciones	-	2,75	-	-	0,06
Juguetes, juegos y aficiones	-	0,32	-	-	-
Transporte	-	1,08	-	-	0,37
Agua	-	-	-	-	0,09
Cartera de inversiones como porcentaje del patrimonio neto	98,29	91,41	26,99	89,71	76,25
Depósitos a plazo	-	-	17,79	-	-
Otros activos netos	1,71	8,59	55,22	10,29	23,75
Total Patrimonio neto	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021

Schroder GAIA BlueTrend

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			130.183.339	63,17
6.800.000	USD	United States Treasury Note 15/10/21, 2.88%	6.807.338	3,30
7.000.000	USD	United States Treasury Note 30/11/21, 1.75%	7.019.468	3,41
4.000.000	USD	United States Treasury Note 15/12/21, 2.63%	4.021.159	1,95
7.000.000	USD	United States Treasury Note 15/01/22, 2.50%	7.049.530	3,42
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/02/22, 2.00%	6.043.472	2,93
7.000.000	USD	United States Treasury Note 15/03/22, 2.38%	7.074.536	3,43
3.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/22, 1.75%	3.545.803	1,72
8.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/22, 1.38%	8.105.419	3,93
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/22, 1.63%	9.152.930	4,44
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/12/22, 1.63%	9.162.949	4,45
6.700.000	USD	United States Treasury Note 15/01/23, 1.50%	6.817.904	3,31
4.300.000	USD	United States Treasury Note 15/02/23, 1.38%	4.371.891	2,12
9.500.000	USD	United States Treasury Note 15/03/23, 0.50%	9.545.831	4,63
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/04/23, 0.25%	10.008.399	4,87
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/05/23, 0.13%	9.986.915	4,85
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/06/23, 0.25%	6.002.461	2,91
9.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/23, 0.13%	9.481.631	4,60
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/08/23, 0.13%	5.985.703	2,90
Total Bonos			130.183.339	63,17
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			130.183.339	63,17
Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Irlanda			16.885.189	8,19
283.308.544	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	16.885.189	8,19
Total Bonos			16.885.189	8,19
Total Otros valores			16.885.189	8,19
Total Inversiones			147.068.528	71,36
Otros activos netos			59.021.812	28,64
Valor liquidativo			206.090.340	100,00

Schroder GAIA Cat Bond

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Supranacional			55.709.500	2,36
550	USD	Voussoir Re SideCar	55.709.500	2,36
Total Renta variable			55.709.500	2,36
Bonos				
Bermudas			852.207.225	36,05
14.963.000	USD	3264 Re 07/02/23, variable	15.357.275	0,65
39.750.000	USD	Acorn Re 10/11/21, variable	39.887.137	1,69
7.500.000	USD	Alamo Re 08/06/22, variable	7.631.625	0,32
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variable	10.375.893	0,44
24.400.000	USD	Bowline Re Series 2018-1 23/05/22, variable	24.891.659	1,05
4.750.000	USD	Bowline Re Series 2019-1A 20/03/23, variable	4.866.613	0,21
14.350.000	USD	Bowline Re Series 2019-1B 20/03/23, variable	14.702.293	0,62
44.750.000	USD	Cape Lookout Re 25/02/22, variable	45.280.287	1,92
20.170	USD	Eden Re II Series A 22/03/22, ZCP	100.353	-
6.006	USD	Eden Re II Series B 22/03/22, ZCP	81.734	-
19.873	USD	Eden Re II Series A 22/03/23, ZCP	247.097	0,01
13.309	USD	Eden Re II Series B 22/03/23, ZCP	415.751	0,02
1.800.000	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP	1.661.040	0,07
7.200.000	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	7.270.560	0,31
16.200.000	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	16.332.840	0,69
19.250.000	USD	Everglades Re Series B1 14/05/24, variable	19.636.925	0,83
11.262.000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variable	11.463.590	0,49
17.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variable	18.071.275	0,76
17.500.000	USD	FloodSmart Re Series A 07/03/22, variable	17.193.750	0,73
3.000.000	USD	FloodSmart Re Series B 07/03/22, variable	2.940.000	0,12
6.500.000	USD	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variable	6.402.500	0,27
9.750.000	USD	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variable	9.530.625	0,40
4.700.000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variable	4.761.570	0,20
3.750.000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variable	3.799.125	0,16

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
2.400.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variable	2.557.200	0,11	44.420.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variable	44.582.132	1,89
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/23, variable	5.123.750	0,22	19.000.000	USD	Northshore Re II 08/07/22, variable	19.392.350	0,82
7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/23, variable	8.071.044	0,34	14.180.000	USD	Northshore Re II 07/07/23, variable	14.745.073	0,62
4.750.000	USD	Kilimanjaro II Re 21/04/22, variable	4.695.613	0,20	12.962.000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variable	13.501.219	0,57
2.850.000	USD	Kilimanjaro II Re Series* 21/04/22, variable	2.871.518	0,12	8.884.000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variable	9.067.010	0,38
15.450.000	USD	Kilimanjaro II Re Series** 21/04/22, variable	15.710.333	0,66	23.029.000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variable	23.503.397	0,99
10.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/23, variable	9.880.488	0,42	5.000.000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variable	5.010.000	0,21
10.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variable	10.626.688	0,45	23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variable	23.305.900	0,99
5.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variable	4.973.588	0,21	5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variable	5.858.675	0,25
9.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variable	9.466.382	0,40	21.500.000	USD	Sanders Re 06/12/21, variable	21.610.725	0,91
3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variable	3.829.875	0,16	2.800.000	USD	Sanders Re 07/04/22, variable	2.250.500	0,10
4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variable	4.904.850	0,21	15.250.000	USD	Sanders Re II 07/04/23, variable	495.625	0,02
8.214.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A2 20/04/26, variable	8.431.671	0,36	5.270.000	USD	Sanders Re II 07/06/23, variable	5.429.945	0,23
4.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variable	4.096.000	0,17	9.625.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variable	9.889.928	0,42
3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variable	3.840.750	0,16	16.447.000	USD	Sanders Re II 07/04/25, variable	16.634.496	0,70
4.950.000	USD	Kilimanjaro Re Series A1 06/05/22, variable	4.895.798	0,21	6.500.000	USD	Sutter Re Series A 06/06/22, variable	6.641.375	0,28
18.600.000	USD	Kilimanjaro Re Series B1 06/05/22, variable	19.002.690	0,80	11.250.000	USD	Sutter Re Series A 23/05/23, variable	11.702.813	0,50
6.000.000	USD	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variable	5.835.300	0,25	7.000.000	USD	Sutter Re Series F 06/06/22, variable	7.173.250	0,30
17.600.000	USD	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variable	18.032.080	0,76	10.800.000	USD	Sutter Re Series F 23/05/23, variable	11.272.500	0,48
1.750.000	USD	Manatee Re III Series A 07/06/22, variable	1.575.000	0,07	14.800.000	USD	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variable	14.896.940	0,63
1.750.000	USD	Manatee Re III Series B 07/06/22, variable	243.250	0,01	14.900.000	USD	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variable	15.040.805	0,64
18.312.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/22, variable	18.361.442	0,78	9.550.000	USD	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variable	9.663.168	0,41
25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variable	26.343.177	1,11	9.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variable	9.689.525	0,41
7.000.000	USD	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variable	7.160.650	0,30	6.920.000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variable	7.123.448	0,30
9.714.000	USD	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variable	9.920.423	0,42	1.460.000	USD	Voussoir Re perpetual, variable	139.795	0,01
30.000.000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variable	30.913.499	1,31	3.500.000	USD	Wrigley Re 08/07/24, variable	3.522.225	0,15
15.690.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variable	15.799.830	0,67					
					Hong Kong			2.908.800	0,12
					3.000.000	USD	Greater Bay Re 15/10/22, ZCP	2.908.800	0,12

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Irlanda				9.168.247	0,39				
7.856.000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variable	9.168.247	0,39					
Singapur				39.135.145	1,66				
17.250.000	USD	Alamo Re II 08/06/23, variable	18.196.163	0,77					
9.783.000	USD	Easton Re 08/01/24, variable	9.940.995	0,42					
6.750.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variable	6.772.950	0,29					
4.012.000	USD	Phoenix 1 Re 04/01/27, ZCP	4.225.037	0,18					
Supranacional				58.513.656	2,48				
3.450.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variable	3.500.025	0,15					
14.800.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variable	15.070.840	0,64					
18.500.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variable	18.703.499	0,79					
3.697.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variable	3.751.346	0,16					
5.550.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variable	5.619.375	0,24					
6.700.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variable	6.925.958	0,29					
4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variable	4.942.613	0,21					
Reino Unido				18.099.050	0,77				
17.000.000	USD	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variable	18.099.050	0,77					
Total Bonos			980.032.123	41,47					
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			1.035.741.623	43,83					
Bonos									
Bermudas									
7.308.000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variable	7.589.723	0,32	21.900.000	USD	Akibare Re Series A 07/04/22, variable	22.057.680	0,93
8.000.000	USD	Akibare Re Series B 07/04/22, variable	8.076.800	0,34	3.673.921	USD	Akibare Re 07/04/23, variable	12.491	-
39.726.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variable	40.826.410	1,72	9.250.000	USD	Armor Re II 08/06/22, variable	9.446.563	0,40
19.855.000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variable	20.326.556	0,86	16.996.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variable	17.350.367	0,73
7.500.000	USD	Cape Lookout Re 09/05/22, variable	7.675.875	0,32	24.917.000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variable	25.113.844	1,06
816.477	USD	Citrus Re 20/03/23, variable	490.662	0,02	11.000.000	USD	Everglades Re II 04/05/23, variable	11.403.150	0,48
31.404.000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variable	29.990.820	1,27	5.625.000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variable	5.343.750	0,23
12.850.000	USD	Frontline Re Series A 06/07/22, variable	11.243.750	0,48	1.499.378	USD	Frontline Re Series B 06/07/22, variable	74.969	-
2.500.000	USD	Herbie Re 06/01/23, variable	2.328.125	0,10	7.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variable	6.300.000	0,27
3.833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variable	4.080.420	0,17	5.114.000	USD	Hypatia Series A 07/06/23, variable	5.409.589	0,23
379.000	USD	Hypatia Series B 07/06/23, variable	404.355	0,02	4.950.000	USD	Integrity Re 10/06/22, variable	5.049.248	0,21
6.000.000	USD	Isosceles Insurance 10/07/23, variable	5.850.000	0,25	7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variable	8.058.139	0,34
6.500.000	USD	Matterhorn Re 07/12/21, variable	6.582.875	0,28					

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	
12.000.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variable	12.117.000	0,51	3.500.000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variable	3.549.700	0,15	
3.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variable	3.549.525	0,15	20.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variable	20.072.000	0,85	
16.000.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/21, variable	16.021.600	0,68	19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variable	19.511.800	0,83	
17.000.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/21, ZCP	16.745.850	0,71	22.982.000	USD	Ursa Re 10/12/22, variable	23.615.154	1,00	
7.250.000	USD	Matterhorn Re Series B* 07/12/21, variable	7.268.125	0,31	41.725.000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variable	43.335.585	1,82	
13.118.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/22, variable	13.383.640	0,57	9.500.000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variable	9.812.550	0,42	
14.250.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/22, variable	14.458.763	0,61	21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variable	21.846.735	0,92	
7.500.000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variable	7.422.000	0,31	Islas Caimán				177.845.511	7,53
15.500.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/23, variable	15.717.000	0,67	1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variable	550.347	0,02	
22.340.000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variable	22.688.504	0,96	6.600.000	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variable	957.000	0,04	
6.000.000	USD	MetroCat Re 08/05/23, variable	6.154.200	0,26	132.536	USD	Caelus Re V Series D 05/06/24, variable	1.352	-	
20.000.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variable	20.454.000	0,87	6.350.000	USD	Caelus Re VI 07/06/23, variable	6.598.920	0,28	
5.333.000	USD	Mystic Re IV Series A 08/01/25, variable	5.399.929	0,23	13.050.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variable	13.686.839	0,58	
4.286.000	USD	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variable	3.480.232	0,15	26.000.000	USD	Long Point Re III 01/06/22, variable	26.321.099	1,12	
15.750.000	USD	Nakama Re 13/10/21, variable	15.809.063	0,67	10.050.000	USD	Residential Reinsurance 2017 06/12/21, variable	10.022.363	0,42	
12.952.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variable	12.999.275	0,55	15.400.000	USD	Residential Reinsurance 2018 Series 13 06/06/22, variable	15.550.149	0,67	
8.500.000	USD	Nakama Re 144A 13/10/21, variable	8.531.875	0,36	11.975.000	USD	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variable	11.869.021	0,50	
21.325.000	USD	Nakama Re Series 1 13/04/23, variable	21.394.306	0,91	4.000.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variable	4.056.000	0,17	
12.200.000	USD	Nakama Re Series 2 13/04/23, variable	12.254.290	0,52	2.250.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variable	2.253.938	0,10	
7.500.000	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variable	5.250.000	0,22	7.062.000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variable	7.012.919	0,30	
4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variable	4.714.375	0,20	6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variable	6.258.310	0,26	
2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variable	2.250.000	0,10	5.484.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variable	5.542.405	0,23	
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variable	20.303.222	0,86	5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variable	5.150.250	0,22	
17.292.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variable	17.639.569	0,75	4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variable	4.321.400	0,18	
3.750.000	USD	Sierra Series A 28/12/22, variable	3.800.063	0,16	5.535.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variable	5.621.900	0,24	
2.750.000	USD	Sierra Series B 28/12/22, variable	2.807.888	0,12						
14.500.000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variable	14.634.850	0,62						

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variable	4.712.558	0,20
6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variable	6.583.850	0,28
1.050.000	USD	Vitality Re IX Series A 10/01/22, variable	1.046.063	0,04
1.900.000	USD	Vitality Re IX Series B 10/01/22, variable	1.886.605	0,08
5.250.000	USD	Vitality Re X Series A 10/01/23, variable	5.177.813	0,22
2.250.000	USD	Vitality Re X Series B 10/01/23, variable	2.199.263	0,09
9.117.000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variable	8.984.348	0,38
3.500.000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variable	3.432.275	0,15
12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variable	12.050.624	0,51
6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variable	5.997.900	0,25
Irlanda			66.048.767	2,80
10.000.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variable	10.653.500	0,45
10.966.000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variable	12.765.978	0,54
4.350.000	EUR	Hexagon Reinsurance DAC Series A 19/01/22, variable	5.048.900	0,21
4.000.000	EUR	Hexagon Reinsurance DAC Series B 19/01/22, variable	4.641.508	0,20
20.000.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variable	23.216.809	0,99
8.269.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variable	9.722.072	0,41
Singapur			30.977.837	1,31
4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variable	4.081.400	0,17
6.000.000	USD	Catahoula Re 09/05/23, variable	322.500	0,01
6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variable	6.592.860	0,28
9.966.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variable	10.234.583	0,44
5.000.000	USD	Umigame Re Series A-1 07/04/25, variable	5.057.250	0,21
2.750.000	USD	Umigame Re Series A-2 07/04/25, variable	2.783.963	0,12
1.875.000	USD	Umigame Re Series B-1 07/04/25, variable	1.905.281	0,08

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Reino Unido			43.107.454	1,82
27.275.000	USD	Atlas Capital UK 2018 07/06/22, variable	27.538.204	1,16
15.000.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variable	15.569.250	0,66
Estados Unidos			204.644.213	8,66
7.920.000	USD	Chesterfield Financial Holdings 15/12/34, 4.50%	8.098.200	0,34
8.307.000	USD	Putnam Re 07/06/24, variable	8.499.722	0,36
75.000.000	USD	United States Treasury Bill 14/10/21, ZCP	74.999.526	3,17
100.000.000	USD	United States Treasury Bill 18/11/21, ZCP	99.996.667	4,24
12.803.000	USD	Vista Re 21/05/24, variable	13.050.098	0,55
Total Bonos			1.232.702.611	52,17
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			1.232.702.611	52,17

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			20.784.238	0,88
14.753.326	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5.96%	16.007.358	0,68
2.400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
4.342.618	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	4.776.880	0,20
Total Bonos			20.784.238	0,88
Total Otros valores			20.784.238	0,88
Total Inversiones			2.289.228.472	96,88
Otros activos netos			73.811.053	3,12
Valor liquidativo			2.363.039.525	100,00

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Israel			4.836.398	1,09
162.568	USD	WalkMe	4.836.398	1,09
Estados Unidos			393.932.686	89,19
116.986	USD	Activision Blizzard	9.053.547	2,05
1.098.367	USD	Avaya Holdings	21.736.683	4,92
52.809	USD	Blackline	6.234.631	1,41
736.000	USD	Cargurus	23.117.760	5,23
204.814	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	2.152.595	0,49
190.495	USD	Ceridian HCM Holding	21.453.547	4,86
121.783	USD	Cirrus Logic	10.028.830	2,27
380.369	USD	Cornerstone OnDemand	21.779.929	4,93
382.368	USD	Coursera	12.101.947	2,74
3.322	USD	Freshworks	141.816	0,03
296.177	USD	Green Dot	14.906.588	3,37
340.240	USD	Marvell Technology	20.519.874	4,65
140.295	USD	nCino	9.965.154	2,26
545.500	USD	NCR	21.143.580	4,79
291.405	USD	New Relic	20.914.137	4,73
1.816.250	USD	News	42.736.362	9,68
704.018	USD	Outfront Media	17.741.254	4,02
81.123	USD	Qorvo	13.562.954	3,07
398.288	USD	Redfin	19.954.229	4,52
116.196	USD	Toast	5.803.990	1,31
131.048	USD	TripAdvisor	4.435.975	1,00
334.103	USD	Twitter	20.176.480	4,57
229.796	USD	Xerox Holdings	4.634.985	1,05
55.421	USD	Zendesk	6.450.450	1,46
306.133	USD	Zillow Group	26.982.563	6,11
12.761	USD	Zoom Video Communications	3.337.002	0,76
49.065	USD	Zscaler	12.865.824	2,91
Total Renta variable			398.769.084	90,28
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			398.769.084	90,28
Total Inversiones			398.769.084	90,28
Otros activos netos			42.934.276	9,72
Valor liquidativo			441.703.360	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en EUR	% Patrimonio neto
Renta variable				
Canadá			136.652.049	14,39
389.334	CAD	Canadian National Railway	38.950.220	4,10
1.403.109	CAD	Canadian Pacific Railway	79.098.844	8,33
15.894	USD	Shopify	18.602.985	1,96
India			9.261.939	0,98
290.111	INR	Housing Development Finance	9.261.939	0,98
Rusia			7.402.189	0,78
107.596	USD	Yandex	7.402.189	0,78
Taiwán			36.815.513	3,88
31.644	USD	Sea	8.707.120	0,92
1.564.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	28.108.393	2,96
Reino Unido			46.853.420	4,93
184.991	USD	Linde	46.853.420	4,93
Estados Unidos			676.457.833	71,25
35.867	USD	Alphabet	82.528.314	8,70
6.632	USD	Amazon.com	18.808.120	1,98
157.067	USD	Analog Devices	22.709.527	2,39
658.684	USD	Bath & Body Works	35.841.371	3,77
174.431	USD	Blackstone Mortgage Trust	4.565.760	0,48
705.101	USD	Charles Schwab	44.338.548	4,67
103.147	USD	Charter Communications	64.786.663	6,83
185.130	USD	CIT Group	8.302.761	0,87
801.141	USD	Comcast	38.682.450	4,07
1.667.426	USD	CSX	42.810.247	4,51
426.887	USD	DR Horton	30.945.484	3,26
122.926	USD	Facebook	36.016.623	3,79
13.398	USD	First Citizens BancShares	9.752.486	1,03
109.974	USD	Herbalife Nutrition	4.023.566	0,42
41.893	USD	International Flavors & Fragrances	4.836.131	0,51
319.804	USD	KKR	16.808.104	1,77
34.398	USD	Mastercard	10.324.597	1,09
194.852	USD	Microsoft	47.423.210	5,00
33.216	USD	Netflix	17.501.665	1,84
66.915	USD	PayPal Holdings	15.031.685	1,58
124.171	USD	PVH	11.018.722	1,16
8.093	USD	RH	4.659.475	0,49
22.730	USD	Square	4.706.318	0,50
62.673	USD	T-Mobile US	6.912.507	0,73

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en EUR	% Patrimonio neto
101.954	USD	UnitedHealth Group	34.391.597	3,62
181.907	USD	Victoria's Secret	8.678.017	0,91
236.082	USD	Visa	45.398.425	4,79
31.879	USD	Vulcan Materials	4.655.460	0,49
Total Renta variable			913.442.943	96,21
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			913.442.943	96,21
Total Inversiones			913.442.943	96,21
Otros activos netos			36.022.074	3,79
Valor liquidativo			949.465.017	100,00

Schroder GAIA Helix

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Bélgica			6.719.744	0,92
213.277	EUR	Azelis Group	6.719.744	0,92
Brasil			16.264.935	2,22
12.200	BRL	Aeris Industria E Comercio de Equipamentos Para Geracao de Energia	17.900	-
1.405.200	BRL	B3 - Brasil Bolsa Balcao	3.287.380	0,45
26.693	BRL	Banco do Brasil	141.657	0,02
59.090	BRL	BR Malls Participacoes	87.673	0,01
5.300	BRL	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista	23.669	-
19.406	USD	Itau Unibanco Holding	102.270	0,01
1.893.000	BRL	Itausa	3.872.381	0,53
269.182	BRL	Lojas Renner	1.701.372	0,23
1.638.300	BRL	Raia Drogasil	7.030.633	0,97
Canadá			2.796	-
704	CAD	Loop Energy	2.796	-
Chile			1.974.186	0,27
237.841	CLP	Empresas COPEC	1.974.186	0,27
China			51.860.663	7,09
12.989	CNH	Advanced Micro-Fabrication Equipment	305.792	0,04
58.600	CNH	Autobio Diagnostics	484.399	0,07
123.600	HKD	Baozun	722.422	0,10
377.000	HKD	Budweiser Brewing	955.981	0,13
41.300	CNH	BYD	1.598.146	0,22
12.600	HKD	China Gas Holdings	37.227	0,01
642.373	CNH	China Jushi	1.751.397	0,24
292.000	HKD	China Mengniu Dairy	1.881.112	0,26
94.700	CNH	China Tourism Group Duty Free	3.818.578	0,52
25.400	CNH	Contemporary Ampere Technology	2.070.975	0,28
222.200	CNH	Estun Automation	755.376	0,10
13.800	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	235.424	0,03
50.988	CNH	Gongniu Group	1.290.921	0,18
348.195	CNH	Gree Real Estate	392.046	0,05
442.500	CNH	Huafon Chemical	835.184	0,11
237.458	CNH	JCET Group	1.181.039	0,16
135.860	CNH	Jiangsu Hengrui Medicine	1.058.359	0,14
23.538	USD	JinkoSolar Holding	1.078.276	0,15

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
58.716	CNH	Keboda Technology	515.863	0,07
4.800	CNH	Kweichow Moutai	1.362.293	0,19
237.400	CNH	LB Group	1.057.042	0,14
244.520	CNH	LONGi Green Energy Technology	3.127.817	0,43
763.367	CNH	Midea Group	8.239.880	1,13
65.385	CNH	Oppein Home Group	1.327.078	0,18
130.000	HKD	PICC Property & Casualty	126.081	0,02
244.300	CNH	Sany Heavy Industry	963.871	0,13
48.100	CNH	SF Holding	487.494	0,07
26.553	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	169.458	0,02
80.704	CNH	Shanghai Kelai Mechatronics Engineering	411.283	0,06
144.400	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1.410.867	0,19
34.500	CNH	Shenzhen Kangtai Biological Products	589.255	0,08
140.457	CNH	Shenzhen Senior Technology Material	981.333	0,13
112.218	CNH	Shenzhen Sunlord Electronics	590.507	0,08
20.400	CNH	Skshu Paint	316.380	0,04
2.200	HKD	Tencent Holdings	130.395	0,02
145.868	CNH	Thunder Software Technology	2.832.096	0,39
56.376	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	610.453	0,08
153.000	CNH	Yunnan Baiyao Group	2.320.407	0,32
149.100	CNH	Zhejiang Dingli Machinery	1.630.216	0,22
161.847	CNH	Zhejiang Jiechang Linear Motion Technology	1.065.769	0,15
203.000	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	1.142.171	0,16
República Checa			2.069.678	0,28
51.074	CZK	Komerční banka	2.069.678	0,28
Egipto			1.417.391	0,19
490.091	USD	Commercial International Bank Egypt	1.308.543	0,18
231.228	EGP	Talaat Moustafa Group	108.848	0,01
Georgia			4.920.895	0,67
186.356	GBP	Georgia Capital	1.506.576	0,21
174.759	GBP	TBC Bank Group	3.414.319	0,46
Grecia			8.798.877	1,20
3.845.960	EUR	Alpha Services & Holdings	4.878.189	0,67
1.113.135	EUR	Eurobank Ergasias Services & Holdings	1.044.414	0,14
1.021.260	EUR	National Bank of Greece	2.862.803	0,39
1.013	EUR	Terna Energy	13.471	-
Hungría			14.057.197	1,92
130.091	HUF	OTP Bank	7.630.979	1,04
234.986	HUF	Richter Gedeon	6.426.218	0,88
Indonesia			9.564.132	1,31
2.515.900	IDR	Bank Central Asia	6.152.420	0,84
6.309.300	IDR	Bank Mandiri Persero	2.711.070	0,37
2.717.600	IDR	Telekomunikasi Indonesia Persero	700.642	0,10
Italia			13.568.159	1,85
15.460	EUR	Amplifon	737.813	0,10
4.629	EUR	DiaSorin	972.399	0,13
228.653	EUR	Eni	3.058.077	0,41
9.010	EUR	Falck Renewables	70.187	0,01
113.673	EUR	FinecoBank Banca Fineco	2.063.318	0,28
63.471	EUR	GVS	904.316	0,12
815.128	EUR	Intesa Sanpaolo	2.316.603	0,32
20.847	EUR	Moncler	1.280.333	0,18
18.828	EUR	Nexi	352.440	0,05
16.606	EUR	Philogen	266.990	0,04
42.680	EUR	Prysmian	1.498.972	0,20
6.572	EUR	Terna-Rete Elettrica Nazionale	46.711	0,01
Japón			458.781	0,06
14.800	JPY	WealthNavi	458.781	0,06
Kazajistán			8.390.534	1,15
316.363	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	5.378.171	0,74
28.365	USD	Kaspi.KZ JSC	3.012.363	0,41
Kenia			1.621.692	0,22
4.216.400	KES	Safaricom	1.621.692	0,22
México			366.553	0,05
26.068	USD	Banco Santander Mexico Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	149.370	0,02
64.162	MXN	Corp Moctezuma SAB de CV	217.183	0,03
Países Bajos			517.444	0,07
6.126	EUR	EXOR	517.444	0,07
Filipinas			4.114.503	0,56
650.320	PHP	Ayala Land	427.087	0,06
277.290	PHP	International Container Terminal Services	1.060.019	0,14

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
280.460	PHP	Universal Robina	747.197	0,10	172.541	KRW	Samsung Electronics-Preference	10.142.613	1,40
3.487.600	PHP	Wilcon Depot	1.880.200	0,26	17.444	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	3.462.280	0,47
Polonia			24.180.215	3,31	2.274	KRW	Samsung SDI	1.378.997	0,19
1.724.318	PLN	Bank Millennium	2.922.095	0,40	26.250	KRW	SK Hynix	2.283.573	0,31
101.186	PLN	CCC	3.075.841	0,42	4.033	KRW	SK Telecom	1.103.625	0,15
16.972	PLN	KGHM Polska Miedz	672.735	0,09	España			57.304	0,01
44.170	PLN	KRUK	3.607.119	0,49	1.181	EUR	Corp ACCIONA Energias Renovables	38.756	0,01
934	PLN	LPP	3.475.567	0,48	2.299	EUR	Soltec Power Holdings	18.548	-
46.534	PLN	mBank	4.808.719	0,66	Suecia			27.412	-
313.783	PLN	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	3.332.502	0,46	4.848	SEK	OX2	27.412	-
17.266	PLN	TEN Square Games	2.285.637	0,31	Suiza			2.508.991	0,34
Rusia			88.300.376	12,08	592.942	ZAR	Mediclinic International	2.508.991	0,34
77.525	USD	Fix Price Group	696.562	0,10	Taiwán			106.278.975	14,54
1.174.241	USD	Gazprom	11.725.971	1,60	187.792	TWD	Advantech	2.460.260	0,34
115.292	USD	LUKOIL	11.047.279	1,51	33.000	TWD	Andes Technology	471.420	0,06
309.462	USD	Magnit	5.214.435	0,71	890.000	TWD	ASE Technology Holding	3.481.991	0,48
60.081	USD	MMC Norilsk Nickel	1.798.224	0,25	425.000	TWD	Chroma ATE	2.684.805	0,37
40.671	USD	Novatek	10.741.211	1,47	845.000	TWD	CTBC Financial Holding	694.550	0,09
21.087	USD	Novatek-GDR	5.569.077	0,76	28.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	155.139	0,02
145.986	GBP	Polymetal International	2.474.505	0,34	111.000	TWD	Delta Electronics	1.004.002	0,14
6.073	USD	Polyus	499.201	0,07	369.000	TWD	Formosa Plastics	1.503.257	0,21
766.949	USD	Rosneft Oil	6.480.719	0,89	984.000	TWD	Getac Technology	1.825.983	0,25
704.212	USD	Sberbank of Russia	13.253.270	1,82	70.990	TWD	Hiwin Technologies	788.622	0,11
88.019	USD	TCS Group Holding	8.080.144	1,10	1.088.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	4.100.429	0,56
72.618	USD	X5 Retail Group	2.357.906	0,32	433.000	TWD	MediaTek	14.065.254	1,92
104.930	USD	Yandex	8.361.872	1,14	196.000	TWD	Mega Financial Holding	225.473	0,03
Eslovenia			6.282.081	0,86	234.000	TWD	Merida Industry	2.456.704	0,34
371.459	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	6.282.081	0,86	215.000	TWD	Nien Made Enterprise	3.055.939	0,42
Sudáfrica			2.260.084	0,31	218.000	TWD	Novatek Microelectronics	3.208.126	0,44
17.399	ZAR	Capitec Bank Holdings	2.101.803	0,29	310	USD	Sea	98.806	0,01
36.948	ZAR	FirstRand	158.281	0,02	138.750	TWD	Sporton International	1.090.657	0,15
Corea del Sur			57.263.747	7,83	2.706.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	56.333.519	7,71
10.054	KRW	Hana Financial Group	394.008	0,05	73.000	TWD	TCI	596.095	0,08
9.818	KRW	KB Financial Group	458.560	0,06	400.000	TWD	Uni-President Enterprises	980.600	0,13
6.228	KRW	Korea Zinc	2.645.848	0,36	55.000	TWD	Universal Vision Biotechnology	610.003	0,08
11.242	KRW	LG Chem	7.368.068	1,01	348.000	TWD	Vanguard International Semiconductor	1.892.357	0,26
1.148	KRW	LG Chem-Preference	364.083	0,05	40.650	TWD	Voltronic Power Technology	2.494.984	0,34
1.640	KRW	LG Household & Health Care	1.851.926	0,25					
8.652	KRW	LG Uplus	109.611	0,01					
15.709	KRW	NAVER	5.147.882	0,70					
328.399	KRW	Samsung Electronics	20.552.673	2,82					

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Tailandia			5.196.198	0,71
512.800	THB	Kasikornbank	2.023.313	0,28
700.000	THB	Kasikornbank-XDR	2.761.933	0,37
1.749.000	THB	Land & Houses	410.952	0,06
Turquía			22.629.246	3,09
278.233	TRY	Coca-Cola Icecek	2.656.244	0,36
2.507.476	TRY	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	4.694.645	0,64
374.512	TRY	Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret	2.712.085	0,37
270.190	TRY	Migros Ticaret	957.651	0,13
1.080.273	TRY	MLP Saglik Hizmetleri	3.338.120	0,46
1.809.647	TRY	Sok Marketler Ticaret	2.401.196	0,33
1.003.764	TRY	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi	5.869.305	0,80
Emiratos Árabes Unidos			226.994	0,03
204.359	AED	Emaar Properties	226.994	0,03
Reino Unido			15.934.753	2,18
99.712	EUR	CNH Industrial	1.697.870	0,23
391.272	GBP	de La Rue	970.048	0,13
124.333	GBP	Gresham House	1.519.463	0,21
398.780	GBP	Melrose Industries	935.199	0,13
461.167	PLN	Pepco Group	5.913.512	0,81
38.035	GBP	Rathbone Brothers	1.032.654	0,14
2.760	GBP	Saietta Group	8.832	0
78.210	GBP	Science in Sport	81.670	0,01
416.587	GBP	TT Electronics	1.456.598	0,20
143.341	GBP	Vesuvius	942.512	0,13
107.983	GBP	Watches of Switzerland Group	1.376.395	0,19
Estados Unidos			18.339.705	2,51
2.212	USD	Array Technologies	40.966	0,01
347.787	GBP	Avast	2.660.757	0,36
4.124	USD	First Republic Bank	795.437	0,11
162.572	PLN	HUUUGE	1.667.720	0,23
14.348	USD	Mastercard	4.988.513	0,68
14.000	TWD	Parade Technologies	831.643	0,11
7.684	USD	Privia Health Group	181.035	0,02
20.506	USD	Silverback Therapeutics	204.650	0,03
21.527	EUR	Stellantis	411.989	0,06
17.689	USD	TuSimple Holdings	656.793	0,09
26.488	USD	Visa	5.900.202	0,81
Total Renta variable			496.174.241	67,83

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Argentina			160.609	0,02
173.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/01/38, 2.00%	67.532	0,01
34.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50%	12.556	-
241.741	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/46, 1.13%	80.521	0,01
Brasil			317.714	0,04
1.256.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	227.203	0,03
510.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	90.511	0,01
China			129.294	0,02
200.000	USD	Yuzhou Group Holdings 13/01/27, 6.35%	129.294	0,02
Colombia			231.081	0,03
928.400.000	COP	Colombian TES 30/06/32, 7.00%	231.081	0,03
Ecuador			237.865	0,03
270.319	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/35, 1.00%	179.426	0,02
100.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 0.50%	58.439	0,01
Egipto			101.523	0,01
1.450.000	EGP	Egypt Government Bond 09/05/27, 17.18%	101.523	0,01
Indonesia			549.692	0,08
4.100.000.000	IDR	Indonesia Treasury Bond 15/09/30, 7.00%	300.930	0,05
2.100.000.000	IDR	Indonesia Treasury Bond 15/06/36, 6.25%	144.986	0,02
1.260.000.000	IDR	Indonesia Treasury Bond 15/02/44, 8.75%	103.776	0,01
Costa de Marfil			242.220	0,03
200.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	242.220	0,03
México			727.344	0,11
1.800.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	92.955	0,01
3.600.000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	172.751	0,02

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
1.750.000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	85.546	0,01
3.800.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/09/24, 7.19%	175.858	0,03
4.600.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	200.234	0,04
Rusia			216.860	0,03
8.400.000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 17/05/28, 5.70%	107.033	0,01
7.750.000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 10/04/30, 7.65%	109.827	0,02
Sudáfrica			529.117	0,07
2.740.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/30, 8.00%	169.236	0,03
1.650.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	98.075	0,01
2.700.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	159.309	0,02
1.840.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	102.497	0,01
Supranacional			99.209	0,01
7.120.000	INR	International Finance 25/11/24, 6.30%	99.209	0,01
Turquía			211.810	0,03
200.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	211.810	0,03
Ucrania			268.796	0,04
1.860.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/02/25, 15.84%	75.713	0,01
2.590.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/05/27, 9.79%	84.485	0,01
100.000	USD	Ukraine Government International Bond 01/09/27, 7.75%	108.598	0,02
Total Bonos			4.023.134	0,55
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			500.197.375	68,38

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			124.994.395	17,09
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 07/10/21, ZCP	19.999.863	2,74
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 14/10/21, ZCP	14.999.764	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 21/10/21, ZCP	14.999.663	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 12/11/21, ZCP	14.999.131	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 26/11/21, ZCP	14.999.242	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 02/12/21, ZCP	14.999.040	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 09/12/21, ZCP	14.998.864	2,05
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/12/21, ZCP	14.998.828	2,05
Total Bonos			124.994.395	17,09
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			124.994.395	17,09

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Participaciones en planes de inversión abiertos	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Hong Kong				
17.146	USD	Schroder Umbrella Fund II-China Equity Alpha Fund	7.341.917	1,00
Luxemburgo			18.882.739	2,58
28.006	USD	Schroder ISF Indian Equity	10.458.205	1,43
76.669	USD	Schroder ISF Securitised Credit	8.424.534	1,15
Total Participaciones en planes de inversión abiertos			26.224.656	3,58

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Rusia			1.546.831	0,21
154.900	USD	Gazprom	1.546.831	0,21
Total Renta variable			1.546.831	0,21
Total Otros valores			1.546.831	0,21
Total Inversiones			652.963.257	89,26
Otros activos netos			78.569.644	10,74
Valor liquidativo			731.532.901	100,00

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit*

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Argentina			1.065.336	3,72
250.000	USD	Transportadora de Gas del Sur 02/05/25, 6.75%	233.625	0,82
775.000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	601.931	2,10
250.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	229.780	0,80
Canadá			120.213	0,42
100.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	120.213	0,42
Francia			708.151	2,47
100.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	119.235	0,42
100.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	114.311	0,40
100.000	EUR	Banijay Entertainment 01/03/25, 3.50%	117.315	0,41
100.000	EUR	Chrome Bidco 31/05/28, 3.50%	118.658	0,41
100.000	EUR	Laboratoire Eimer Selas 01/02/29, 5.00%	119.959	0,42
100.000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	118.673	0,41
Alemania			235.999	0,82
100.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/01/28, 4.38%	120.689	0,42
100.000	EUR	Nidda Healthcare Holding 30/09/24, 3.50%	115.310	0,40
Irlanda			113.646	0,40
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variable	113.646	0,40
Italia			237.451	0,83
100.000	EUR	Brunello Bidco 15/02/28, 3.50%	115.933	0,40
100.000	EUR	Centurion Bidco 30/09/26, 5.88%	121.518	0,43
Luxemburgo			693.634	2,42
100.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	109.325	0,38
95.000	USD	ARD Finance 30/06/27, 6.50%	100.938	0,35
100.000	EUR	INEOS Finance 01/05/26, 2.88%	116.993	0,41
100.000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	118.853	0,42
100.000	EUR	Monitchem HoldCo 2 15/09/26, 9.50%	125.898	0,44
100.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	121.627	0,42
Países Bajos			474.396	1,66
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	118.801	0,41
115.000	USD	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 5.50%	120.585	0,43
100.000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3.88%	119.175	0,42
100.000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3.38%	115.835	0,40
España			468.057	1,64
100.000	EUR	Cirsa Finance International 15/03/27, 4.50%	114.819	0,40
100.000	EUR	eDreams ODIGEO 01/09/23, 5.50%	116.496	0,41
100.000	EUR	Grifols Escrow Issuer 15/10/28, 3.88%	117.343	0,41
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variable	119.399	0,42
Suecia			234.785	0,82
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden perpetual, variable	115.811	0,40
100.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3.88%	118.974	0,42
Reino Unido			683.192	2,39
100.000	GBP	AA Bond 31/01/26, 6.50%	141.876	0,50
100.000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8.00%	145.256	0,51
100.000	EUR	INEOS Quattro Finance 1 15/07/26, 3.75%	119.247	0,42
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3.50%	135.903	0,47
100.000	GBP	Thames Water Kemble Finance 19/05/26, 4.63%	140.910	0,49
Estados Unidos			865.322	3,02
105.000	USD	Covanta Holding 01/09/30, 5.00%	106.185	0,37
100.000	EUR	Energizer Gamma Acquisition 30/06/29, 3.50%	115.176	0,40
55.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6.00%	55.928	0,20
115.000	USD	Olin 01/08/29, 5.63%	126.571	0,44
135.000	USD	PG&E 01/07/28, 5.00%	137.306	0,48
100.000	EUR	Scientific Games International 15/02/26, 3.38%	117.144	0,41
200.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	207.012	0,72
Total Bonos			5.900.182	20,61
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			5.900.182	20,61

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros. Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit* (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Argentina			387.004	1,35
400.000	USD	Telecom Argentina 06/08/25, 8.50%	387.004	1,35
Australia			388.176	1,36
262.000	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variable	190.575	0,67
272.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variable	197.601	0,69
Brasil			191.308	0,67
200.000	USD	Azul Investments 15/06/26, 7.25%	191.308	0,67
Canadá			693.163	2,42
90.000	USD	Bombardier 15/06/26, 7.13%	94.838	0,33
165.000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	173.666	0,61
200.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	209.790	0,73
55.000	USD	MEG Energy 01/02/27, 7.13%	57.816	0,20
90.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	92.552	0,32
65.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	64.501	0,23
Islas Caimán			2.984.157	10,42
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variable	233.442	0,82
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variable	238.038	0,83
250.000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variable	253.472	0,89
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variable	358.619	1,25
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variable	371.089	1,29
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variable	251.109	0,88
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variable	247.877	0,87
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variable	251.326	0,88
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variable	376.819	1,31
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variable	402.366	1,40
Alemania			127.813	0,45
125.000	USD	Mercer International 01/02/29, 5.13%	127.813	0,45
Irlanda			3.849.080	13,45
375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variable	433.358	1,51
250.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variable	284.297	0,99
300.000	EUR	Bluemountain Fuji Eur CLO IV DAC 25/02/34, variable	345.345	1,21
375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variable	428.190	1,50
178.000	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variable	206.527	0,72
161.000	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series1A 17/08/33, variable	187.520	0,66
375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variable	422.857	1,48
375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variable	435.633	1,53
250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variable	292.987	1,02
288.000	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variable	390.475	1,36
375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variable	421.891	1,47
Luxemburgo			338.222	1,18
200.000	USD	Intelsat Jackson Holdings 15/02/24, 8.00%**	205.500	0,72
130.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	132.722	0,46
Reino Unido			137.656	0,48
100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	137.656	0,48
Estados Unidos			13.141.892	45,90
195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	210.844	0,74
125.000	USD	Acadia Healthcare 01/07/28, 5.50%	131.558	0,46
65.000	USD	Acadia Healthcare 15/04/29, 5.00%	67.765	0,24
170.000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	171.533	0,60
25.000	USD	Albertsons 15/01/27, 4.63%	26.257	0,09
160.000	USD	Albertsons 15/02/28, 5.88%	170.600	0,60
50.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	49.985	0,17

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remitase al Informe de los Consejeros.

** Valor sometido a impago.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit* (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
125.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	132.316	0,46	65.000	USD	CrownRock 01/05/29, 5.00%	67.948	0,24
55.000	USD	Ambience Merger Sub 15/07/29, 7.13%	54.931	0,19	135.000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 15/05/28, 6.75%	146.644	0,51
30.000	USD	American Airlines 15/07/25, 11.75%	37.163	0,13	40.000	USD	Diamond 01/10/29, 4.63%	40.651	0,14
175.000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	186.296	0,65	95.000	USD	DIRECTV Holdings 15/08/27, 5.88%	99.275	0,35
165.000	USD	Aramark Services 01/02/28, 5.00%	169.759	0,59	195.000	USD	Edgewell Personal Care 01/06/28, 5.50%	206.189	0,72
165.000	USD	Arconic 15/02/28, 6.13%	175.110	0,61	400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variable	399.858	1,40
25.000	USD	Ascent Resources Utica Holdings 01/11/26, 7.00%	25.875	0,09	145.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	146.641	0,51
60.000	USD	Ascent Resources Utica Holdings 31/12/28, 8.25%	65.497	0,23	120.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	126.150	0,44
40.000	USD	AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	40.307	0,14	85.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	89.696	0,31
71.000	USD	Bausch Health 15/04/25, 6.13%	72.510	0,25	95.000	USD	Golden Nugget 15/10/24, 6.75%	95.242	0,33
80.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	83.000	0,29	135.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	142.115	0,50
371.094	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	372.273	1,30	160.000	USD	Hawaiian Brand Intellectual Property 20/01/26, 5.75%	167.600	0,59
250.000	USD	BRSP 19/08/38, variable	250.467	0,87	165.000	USD	Helios Software Holdings 01/05/28, 4.63%	162.731	0,57
145.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	145.751	0,51	65.000	USD	Herbalife International 01/06/29, 4.88%	65.081	0,23
145.000	USD	Calpine 15/03/28, 5.13%	147.028	0,51	125.000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	130.725	0,46
110.000	USD	Churchill Downs 15/01/28, 4.75%	115.225	0,40	150.000	USD	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 01/06/29, 5.00%	153.188	0,54
130.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	133.103	0,46	25.000	USD	iHeartcommunications 01/05/27, 8.38%	26.750	0,09
75.000	USD	Colgate Energy Partners III 15/02/26, 7.75%	79.097	0,28	165.000	USD	iHeartcommunications 15/08/27, 5.25%	171.806	0,60
45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7.13%	46.080	0,16	165.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	172.631	0,60
145.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	147.285	0,51	25.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	26.089	0,09
130.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	136.289	0,48	125.000	USD	KAR Auction Services 01/06/25, 5.13%	126.563	0,44
200.000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/04/29, 5.25%	209.500	0,73	95.000	USD	Kennedy-Wilson 01/03/29, 4.75%	96.781	0,34
35.000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	36.449	0,13	400.000	USD	Kennedy-Wilson 01/02/30, 4.75%	407.499	1,42
165.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	179.441	0,63					
120.000	USD	Constellium 15/06/28, 5.63%	126.287	0,44					
65.000	USD	Coty 15/04/26, 5.00%	66.482	0,23					
115.000	USD	CQP 15/06/31, 5.50%	122.452	0,43					

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros. Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit* (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
200.000	USD	Legends Hospitality Holding 01/02/26, 5.00%	205.326	0,72	95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	99.394	0,35
130.000	USD	MEDNAX 15/01/27, 6.25%	136.825	0,48	135.000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	134.494	0,47
145.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	150.619	0,53	110.000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	118.113	0,41
80.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/11/28, 5.75%	75.479	0,26	40.000	USD	Unifrax Escrow Issuer 30/09/28, 5.25%	40.651	0,14
25.000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	25.577	0,09	160.000	USD	Univision Communications 01/06/27, 6.63%	174.000	0,61
160.000	USD	NCR 01/09/29, 6.13%	173.800	0,61	175.000	USD	US Foods 15/02/29, 4.75%	179.831	0,63
85.000	USD	Nexstar Media 15/07/27, 5.63%	90.126	0,31	10.000	USD	Venture Global Calcasieu Pass 15/08/29, 3.88%	10.313	0,04
120.000	USD	NFP 15/08/28, 4.88%	121.650	0,42	15.000	USD	Venture Global Calcasieu Pass 15/08/31, 4.13%	15.656	0,05
45.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	44.382	0,16	80.000	USD	Vine Energy Holdings 15/04/29, 6.75%	86.500	0,30
10.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/29, 6.25%	9.922	0,03	70.000	USD	Vista Outdoor 15/03/29, 4.50%	71.072	0,25
120.000	USD	Ortho-Clinical Diagnostics 01/06/25, 7.38%	126.787	0,44	170.000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	173.144	0,60
180.000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	188.696	0,66	189.000	USD	VMC Finance 16/06/36, variable	189.334	0,66
140.000	USD	Pike 01/09/28, 5.50%	142.854	0,50	455.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variable	458.265	1,61
140.000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	147.259	0,51	185.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	192.863	0,67
195.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	201.854	0,71	180.000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	192.901	0,67
250.000	USD	PRPM 25/06/26, 3.72%	249.833	0,87	130.000	USD	Xerox Holdings 15/08/25, 5.00%	136.760	0,48
200.000	USD	PRPM 25/09/26, variable	200.345	0,70			Total Bonos	22.238.471	77,68
55.000	USD	Realogy Group 15/01/29, 5.75%	57.125	0,20			Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	22.238.471	77,68
135.000	USD	Sabre GLBL 01/09/25, 7.38%	144.275	0,50			Total Inversiones	28.138.653	98,29
85.000	USD	Scripps Escrow II 15/01/31, 5.38%	83.693	0,29			Otros activos netos	488.258	1,71
165.000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5.63%	172.219	0,60			Valor liquidativo	28.626.911	100,00
160.000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5.50%	173.200	0,61					
85.000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	87.869	0,31					
65.000	USD	Suburban Propane Partners 01/06/31, 5.00%	67.519	0,24					
130.000	USD	Summit Materials Finance 15/01/29, 5.25%	136.663	0,48					
25.000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6.25%	25.969	0,09					
170.000	USD	Tenet Healthcare 15/06/28, 4.63%	176.367	0,62					

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros. Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto		
Renta variable					166.685	USD	IHS Markit	19.438.804	5,73		
Francia					6.799.707	2,01	44.530	USD	Janus Henderson Group	1.840.425	0,54
24.988	EUR	Airbus	3.331.551	0,99	90.920	USD	Johnson Controls International	6.189.834	1,83		
24.902	EUR	BNP Paribas	1.599.180	0,47	84.741	USD	KeyCorp	1.832.100	0,54		
27.704	EUR	Cie de Saint-Gobain	1.868.976	0,55	12.395	USD	Keysight Technologies	2.036.375	0,60		
Israel					1.600.968	0,47	15.660	USD	Kohl's	737.429	0,22
77.906	USD	Cognyte Software	1.600.968	0,47	25.023	USD	Lowe's	5.076.166	1,50		
España					13.770.934	4,07	27.680	USD	Marvell Technology	1.669.381	0,49
223.047	EUR	Cellnex Telecom	13.770.934	4,07	16.006	USD	MasTec	1.380.998	0,41		
Suecia					3.839.072	1,13	3.777	USD	Mastercard	1.313.187	0,39
339.140	SEK	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	3.839.072	1,13	75.630	USD	Medtronic	9.480.221	2,80		
Reino Unido					22.323.952	6,59	19.554	USD	Microsoft	5.512.664	1,63
6.940	EUR	Linde	2.058.775	0,61	22.806	USD	NIKE	3.312.115	0,98		
201.882	GBP	London Stock Exchange Group	20.265.177	5,98	12.835	USD	Old Dominion Freight Line	3.670.553	1,08		
Estados Unidos					258.556.938	76,36	184.628	USD	ON24	3.681.482	1,09
57.729	USD	Abbott Laboratories	6.819.527	2,01	79.992	USD	Option Care Health	1.940.606	0,57		
170.912	USD	Allison Transmission Holdings	6.036.612	1,78	64.369	USD	PACCAR	5.080.001	1,50		
3.671	USD	Alphabet	9.814.492	2,90	31.056	USD	Papa John's International	3.943.801	1,16		
883	USD	Amazon.com	2.900.690	0,86	4.377	USD	PayPal Holdings	1.138.939	0,34		
34.091	USD	Anterix	2.069.324	0,61	24.782	USD	PotlatchDeltic	1.278.256	0,38		
29.309	USD	AZEK	1.070.658	0,32	32.384	USD	PTC	3.879.279	1,15		
189.216	USD	Baker Hughes	4.679.312	1,38	69.489	USD	QUALCOMM	8.962.691	2,65		
19.308	USD	Berry Global Group	1.175.471	0,35	10.653	USD	Roper Technologies	4.752.623	1,40		
30.669	USD	BJ's Wholesale Club Holdings	1.684.341	0,50	64.094	USD	Royal Caribbean Cruises	5.701.161	1,68		
138.295	USD	Boston Scientific	6.000.620	1,77	1.766	USD	S&P Global	750.356	0,22		
28.937	USD	Bumble	1.446.271	0,43	147.825	USD	Sabre	1.750.248	0,52		
8.308	USD	Bunge	675.607	0,20	114.288	USD	Schlumberger	3.387.496	1,00		
250.066	USD	Carnival	6.254.151	1,85	22.764	USD	Sealed Air	1.247.240	0,37		
7.464	USD	ConocoPhillips	505.835	0,15	6.444	USD	Sherwin-Williams	1.802.580	0,53		
63.784	USD	Constellation Brands	13.438.651	3,97	176.210	USD	Southwest Airlines	9.062.480	2,68		
12.806	USD	Crown Holdings	1.290.589	0,38	14.094	USD	Splunk	2.039.543	0,60		
19.362	USD	CyberArk Software	3.055.711	0,90	26.704	USD	T-Mobile US	3.411.703	1,01		
23.722	USD	Danaher	7.221.926	2,13	210.891	USD	Verra Mobility	3.178.127	0,94		
3.242	USD	Darling Ingredients	233.100	0,07	12.303	USD	Walt Disney	2.081.299	0,61		
56.003	USD	DR Horton	4.702.572	1,39	21.975	USD	Waste Connections	2.767.312	0,82		
29.053	USD	Dropbox	848.929	0,25	307.160	USD	Wells Fargo	14.255.296	4,21		
12.360	USD	Eagle Materials	1.621.138	0,48	83.881	USD	Williams-Sonoma	14.874.617	4,39		
14.102	USD	Element Solutions	305.731	0,09	36.700	USD	World Wrestling Entertainment	2.064.742	0,61		
28.539	USD	Eli Lilly	6.593.936	1,95	Total Renta variable				306.891.571	90,63	
8.431	USD	General Mills	504.342	0,15	Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial				306.891.571	90,63	
12.164	USD	Hasbro	1.085.272	0,32							

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			2.655.083	0,78
2.946.000	USD	American Airlines Group 01/03/25, 3.75%	2.655.083	0,78
Total Bonos			2.655.083	0,78
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			2.655.083	0,78
Total Inversiones			309.546.654	91,41
Otros activos netos			29.075.946	8,59
Valor liquidativo			338.622.600	100,00

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Alemania			111.718	0,02
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	20.276	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	21.796	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	19.129	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	17.754	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	18.136	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	14.627	-
Estados Unidos			33.311	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	10.779	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	11.741	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	10.791	-
Total Bonos			145.029	0,02
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			145.029	0,02

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Austria			89.997.025	9,91
90.000.000	USD	Austrian Treasury Bill 18/10/21, ZCP	89.997.025	9,91
Finlandia			74.981.909	8,25
75.000.000	USD	Finland Treasury Bill 17/11/21, ZCP	74.981.909	8,25

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Alemania			74.994.833	8,26
75.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 01/11/21, ZCP	74.994.833	8,26
Estados Unidos			34.071	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2,88%	11.509	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3,00%	11.763	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2,50%	10.799	-
Total Bonos			240.007.838	26,42
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			240.007.838	26,42

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Participaciones en planes de inversión abiertos	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Luxemburgo				
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0,55
Total Renta variable			5.000.000	0,55
Total Participaciones en planes de inversión abiertos			5.000.000	0,55
Total Inversiones			245.152.867	26,99

Depósitos a plazo				
Finanzas				
121.625.000	USD	Banque NA 01/10/21, 0,05%	121.625.000	13,39
40.000.000	USD	Mizuho Bank 01/10/21, 0,07%	40.000.000	4,40
Total Depósitos a plazo			161.625.000	17,79
Otros activos netos			501.610.963	55,22
Valor liquidativo			908.388.830	100,00

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en GBP	% Patrimonio neto
Renta variable				
Reino Unido			9.930.571	30,83
25.191	GBP	AB Dynamics	508.858	1,58
1.296.958	GBP	Comptoir Group	101.163	0,31
292.006	GBP	Creo Medical Group	505.170	1,57
189.767	GBP	De La Rue	349.171	1,08
428.128	GBP	Everyman Media Group	599.379	1,86
21.625	GBP	GB Group	187.056	0,58
61.746	GBP	Gresham House	560.036	1,74
163.285	GBP	Hollywood Bowl Group	395.966	1,23
141.909	GBP	IG Design Group	688.259	2,14
232.130	GBP	Melrose Industries	404.022	1,25
8.113.909	GBP	Napster Group	105.481	0,33
18.663	GBP	Rathbone Brothers	376.059	1,17
598.233	GBP	Science in Sport	463.631	1,44
97.900	GBP	Secure Income Real Estate Investment Trust	408.243	1,27
202.739	GBP	TT Electronics	526.108	1,63
69.688	GBP	Vesuvius	340.077	1,06
65.594	GBP	Vitec Group	983.910	3,06
45.746	GBP	Vp	466.609	1,45
112.929	GBP	WANdisco	345.563	1,07
53.328	GBP	Watches of Switzerland Group	504.483	1,57
179.045	GBP	Wincanton	635.610	1,97
36.692	GBP	Young & Company's Brewery	323.257	1,00
9.900	GBP	Young & Company's Brewery Class A	152.460	0,47
Total Renta variable			9.930.571	30,83
Bonos				
Reino Unido			18.964.204	58,88
1.700.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/03/22, 4,00%	1.729.409	5,37
4.650.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/22, 0,50%	4.663.718	14,48
3.100.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/22, 1,75%	3.145.539	9,77
3.300.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/23, 0,75%	3.327.522	10,33
2.000.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/23, 2,25%	2.075.161	6,44
4.050.000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/24, 0,13%	4.022.855	12,49
Total Bonos			18.964.204	58,88
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			28.894.775	89,71
Total Inversiones			28.894.775	89,71
Otros activos netos			3.313.711	10,29
Valor liquidativo			32.208.486	100,00

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable					China				
			852.604	0,21				5.427.450	1,32
Australia					40.000	HKD	Akeso	219.920	0,05
162.034	AUD	Bellevue Gold	98.985	0,02	5.100	CNH	Amoy Diagnostics	63.434	0,02
128.167	GBP	Glencore	607.618	0,15	630	HKD	Anhui Conch Cement	3.399	-
15.499	AUD	Vulcan Energy Resources	146.001	0,04	34.000	CNH	Anhui Conch Cement Class A	215.138	0,05
Austria					285	USD	BeiGene	103.455	0,03
18.289	EUR	Addiko Bank	288.117	0,07	36.246	HKD	China Gas Holdings	107.090	0,03
34.801	EUR	BAWAG Group	2.219.161	0,54	237.198	HKD	China Longyuan Power Group	586.241	0,14
21.612	EUR	Erste Group Bank	952.804	0,23	3.250	HKD	China Merchants Port Holdings	5.578	-
Bélgica					62.518	HKD	China National Building Material	84.646	0,02
7.921	EUR	Galapagos	414.356	0,10	177.053	HKD	China Pacific Insurance Group	526.520	0,13
3.888	EUR	KBC Ancora	199.512	0,05	11.629	HKD	China Petroleum & Chemical	5.766	-
11.348	EUR	KBC Group	1.025.833	0,25	3.400	HKD	China Shenhua Energy	7.958	-
Brasil					10.856	USD	Connect Biopharma Holdings	259.458	0,06
15.529	USD	XP	623.800	0,15	5.866	CNH	Contemporary Amperex Technology	478.281	0,12
Canadá					204.000	HKD	CSPC Pharmaceutical Group	244.759	0,06
279.878	CAD	ARC Resources	2.622.889	0,65	35.353	HKD	Everest Medicines	223.436	0,05
2.077	USD	Cameco	45.133	0,01	157	CNH	Ganfeng Lithium	3.967	-
2.503	USD	Canadian Natural Resources	91.460	0,02	10.629	HKD	Ganfeng Lithium Class H	188.969	0,05
37.765	USD	Cenovus Energy	379.916	0,09	10.278	USD	Gracell Biotechnologies	142.556	0,03
3.200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-	7.724	HKD	Guangzhou Automobile Group	6.826	-
14.651	CAD	Enerplus	117.291	0,03	188.443	HKD	Hope Education Group	28.080	0,01
153.940	CAD	Headwater Exploration	552.998	0,13	657	HKD	Hutchmed China	4.811	-
18.085	CAD	Intact Financial	2.391.343	0,58	2.460	USD	Hutchmed China-ADR	90.061	0,02
2.390	CAD	Keyera	60.137	0,01	400	CNH	Midea Group	4.318	-
5.896	CAD	Nuvei	675.438	0,16	81.600	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	145.912	0,04
32.652	CAD	Parex Resources	593.954	0,14	30.500	HKD	Venus MedTech Hangzhou	157.502	0,04
423.683	CAD	Storm Resources	1.806.323	0,44	9.428	CNH	Venustech Group	40.371	0,01
24.052	USD	Suncor Energy	498.838	0,12	4.000	CNH	Will Semiconductor Shanghai	150.504	0,04
2.509	CAD	Teck Resources	62.458	0,02	14.399	HKD	WuXi AppTec	336.824	0,08
6.228	USD	Teck Resources	155.139	0,04	438	HKD	XPeng	7.596	-
44.039	CAD	Tourmaline Oil	1.538.549	0,37	6.083	USD	Xpeng-ADR	216.190	0,05
3.317	CAD	West Fraser Timber	279.376	0,07	600	HKD	Zai Lab	64.666	0,02
26.775	CAD	Whitecap Resources	148.186	0,04	6.113	USD	Zai Lab-ADR	644.248	0,16
1.900	USD	Zymeworks	55.176	0,01	4.595	CNH	Zhejiang HangKe Technology	58.970	0,01
Islas Caimán									
6.269	USD	AEA-Bridges Impact	61.311	0,01					
Chile									
87	USD	Sociedad Química y Minera de Chile	4.674	-					

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
República Checa			84.612	0,02
2.088	CZK	Komerční banka	84.612	0,02
Dinamarca			1.637.365	0,40
6.444	USD	Ascendis Pharma	1.027.110	0,25
264	DKK	Genmab	115.510	0,03
35.464	DKK	Spar Nord Bank	412.642	0,10
2.047	DKK	Vestas Wind Systems	82.103	0,02
Finlandia			355.860	0,09
27.545	SEK	Nordea Bank Abp	355.860	0,09
Francia			6.220.515	1,51
50.704	EUR	ALD	693.049	0,17
32.553	EUR	AXA	908.192	0,22
4.329	EUR	Cie de Saint-Gobain	292.044	0,07
51.766	EUR	Crédit Agricole	716.320	0,17
3.888	USD	Criteo	142.495	0,03
87.490	EUR	Engie	1.149.444	0,28
3.202	EUR	Legrand	344.050	0,08
3.952	EUR	Rothschild	171.210	0,04
1.639	EUR	Safran	208.193	0,05
7.567	EUR	TotalEnergies	362.311	0,09
7.761	EUR	Vallourec	67.874	0,02
11.652	EUR	Veolia Environnement	357.133	0,09
5.817	EUR	Veolia Environnement-Rights	4.838	-
770	EUR	Vinci	80.407	0,02
9.455	EUR	Worldline	722.955	0,18
Alemania			3.652.673	0,89
570	EUR	Brenntag	53.204	0,01
120.731	EUR	Commerzbank	804.830	0,20
15.338	EUR	Deutsche Bank	196.110	0,05
890	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft	244.228	0,06
612	EUR	RWE	21.657	0,01
6.357	EUR	Siemens	1.045.046	0,25
12.026	EUR	Talanx	513.750	0,12
35.327	EUR	TUI	153.863	0,04
882	EUR	Volkswagen	197.835	0,05
2.258	EUR	Wacker Chemie	422.150	0,10
Hong Kong			1.029.378	0,25
52.347	HKD	AIA Group	604.859	0,15
522	HKD	ASM Pacific Technology	5.777	-
6.794	HKD	Hong Kong Exchanges & Clearing	418.742	0,10
Hungría			641.140	0,16
10.930	HUF	OTP Bank	641.140	0,16
India			3.817.393	0,93
141.559	INR	Coal India	352.241	0,09
3.183	INR	Hindustan Petroleum	12.865	-
20.335	INR	Kotak Mahindra Bank	547.910	0,13
23.916	INR	Mahindra & Mahindra	259.370	0,06
187.714	INR	NTPC	358.598	0,09
4.508	INR	Oil & Natural Gas	8.745	-
240.097	INR	Power Grid of India	612.473	0,15
49.205	INR	Reliance Industries	1.665.191	0,41
Indonesia			217.073	0,05
11.364.300	IDR	Panin Financial	142.922	0,03
1.538.100	IDR	Paninvest	74.151	0,02
Irlanda			1.750.847	0,43
11.291	USD	AerCap Holdings	652.733	0,16
298.744	EUR	AIB Group	812.872	0,20
342	GBP	Flutter Entertainment	67.647	0,02
43.534	EUR	Irish Continental Group	217.595	0,05
Israel			246.346	0,06
8.239	USD	Tower Semiconductor	246.346	0,06
Italia			2.748.322	0,67
12.159	EUR	Banca Generali	533.798	0,13
1.746	EUR	DiaSorin	366.777	0,09
22.748	EUR	Enel	175.255	0,04
263.758	EUR	Intesa Sanpaolo	749.603	0,18
31.683	EUR	Poste Italiane	437.831	0,11
36.413	EUR	UniCredit	485.058	0,12
Japón			3.889.620	0,94
31.243	JPY	Astellas Pharma	517.231	0,13
11.900	JPY	Daiichi Sankyo	318.577	0,08
84	JPY	Daiwa Securities Living Investments	84.381	0,02
4.090	JPY	East Japan Railway	288.187	0,07
2.746	JPY	Hitachi	163.830	0,04
13.800	JPY	Japan Steel Works	361.693	0,09
310	JPY	JFE Holdings	4.727	-
5.000	JPY	Kubota	107.327	0,03
53	JPY	Kureha	3.624	-
98.714	JPY	Mitsubishi UFJ Financial Group	583.529	0,13
100	JPY	Mitsui Mining & Smelting	2.817	-
200	JPY	Nippon Steel	3.655	-

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto		
34.461	JPY	Panasonic	430.395	0,10	España					1.840.326	0,45
85	JPY	Rohm	8.126	-	2.285	USD	Atlantica Sustainable Infrastructure	78.855	0,02		
19.308	JPY	Shinsei Bank	325.111	0,08	101.427	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	671.679	0,17		
16.373	JPY	Showa Denko KK	402.356	0,10	32.911	EUR	CaixaBank	102.321	0,02		
5.100	JPY	Tokio Marine Holdings	275.907	0,07	3.800	EUR	Cellnex Telecom	234.612	0,06		
677	JPY	Toray Industries	4.357	-	5.039	EUR	Endesa	101.679	0,02		
267	JPY	Zeon	3.790	-	26.668	EUR	Grifols	651.180	0,16		
Kazajistán			211.814	0,05	Suecia					2.077.308	0,50
5.975	USD	NAC Kazatomprom	211.814	0,05	12.645	SEK	Alfa Laval	474.636	0,11		
Luxemburgo			948.403	0,23	5.766	SEK	Boliden	185.934	0,05		
23.020	EUR	ArcelorMittal	705.562	0,17	17.426	SEK	Hexagon	270.614	0,07		
5.168	USD	ArcelorMittal-XDR	155.867	0,04	5.546	SEK	Lundin Energy	207.031	0,05		
6.614	USD	Arrival	86.974	0,02	12.349	SEK	Sandvik	283.814	0,07		
Países Bajos			2.689.276	0,65	27.394	SEK	Svenska Handelsbanken	307.660	0,07		
1.457	USD	Argenx	440.014	0,11	15.443	SEK	Volvo	347.619	0,08		
152.323	GBP	DP Eurasia	166.655	0,04	Suiza					748.061	0,18
1.278	EUR	Euronext	144.632	0,04	5.616	CHF	Alcon	458.223	0,11		
6.047	EUR	Koninklijke Philips	268.554	0,07	3.601	EUR	STMicroelectronics	157.526	0,04		
35.938	USD	Merus	790.636	0,19	232	CHF	Tecan Group	132.312	0,03		
1.787	NOK	Pryme	5.499	-	Taiwán					284.078	0,07
38.332	GBP	Royal Dutch Shell	854.784	0,20	9.447	TWD	Accton Technology	89.179	0,02		
822	EUR	Royal Dutch Shell	18.502	-	6.000	TWD	MediaTek	194.899	0,05		
Noruega			792.678	0,19	Tailandia					291.936	0,07
71.623	NOK	Aker Carbon Capture	226.133	0,05	40.797	THB	Kasikornbank	160.969	0,04		
20.309	USD	Equinor	517.880	0,13	33.193	THB	Kasikornbank-NVDR	130.967	0,03		
6.493	NOK	Norsk Hydro	48.665	0,01	Reino Unido					6.495.916	1,58
Perú			180.943	0,04	6.285	GBP	Abcam	126.857	0,03		
1.631	USD	Credicorp	180.943	0,04	76.573	GBP	AJ Bell	411.666	0,10		
Filipinas			3.749	-	46.932	EUR	Allfunds Group	912.222	0,21		
32.194	PHP	Bloomberry Resorts	3.749	-	2.082	GBP	AstraZeneca	251.298	0,06		
Puerto Rico			1.420.507	0,35	114.945	GBP	Babcock International Group	575.832	0,14		
18.289	USD	Popular	1.420.507	0,35	293.726	GBP	Barclays	750.372	0,18		
Eslovenia			228.581	0,06	94.937	GBP	Beazley	485.065	0,12		
13.516	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	228.581	0,06	103.152	GBP	HSBC Holdings	542.119	0,13		
Sudáfrica			912.598	0,22	6.774	GBP	Intermediate Capital Group	186.653	0,05		
16.955	GBP	Anglo American	599.114	0,15	33.535	GBP	National Express Group	108.986	0,03		
26.263	USD	Gold Fields	213.256	0,05	30.136	GBP	National Grid	359.194	0,09		
40.141	ZAR	Rand Merchant Investment Holdings	100.228	0,02	2.600	GBP	Oxford Nanopore Technologies	21.461	0,01		
Corea del Sur			1.196.162	0,29	7.266	GBP	Persimmon	261.203	0,06		
17.114	USD	Coupang	476.626	0,12	25.373	GBP	Prudential	497.429	0,12		
339	KRW	KB Financial Group	15.833	-	28.945	GBP	Rotork	136.034	0,03		
1.506	KRW	Kia	103.283	0,03	237.443	GBP	Serco Group	428.707	0,10		
583	KRW	LG Chem	382.101	0,09							
914	KRW	SK Innovation	204.569	0,05							
148	KRW	S-Oil	13.750	-							

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

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

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

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

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
272	USD	Proterra	2.750	-	11.486	USD	Valaris	400.632	0,10
1.942	USD	Quidel	274.113	0,07	5.730	USD	Valero Energy	404.366	0,10
252	USD	Rapid7	28.481	0,01	3.713	USD	Varonis Systems	225.936	0,05
8.897	USD	Rattler Midstream	104.451	0,03	2.675	USD	Veracyte	124.254	0,03
6.240	USD	RBC Bearings	695.573	0,17	2.207	USD	Verisk Analytics	441.996	0,11
1.247	USD	Reata Pharmaceuticals	125.461	0,03	7.691	USD	Veritex Holdings	302.718	0,07
10.934	USD	Repay Holdings	251.810	0,06	5.927	USD	Verve Therapeutics	278.569	0,07
3.472	USD	Rhythm Pharmaceuticals	45.344	0,01	37.567	USD	Vine Energy	618.728	0,15
29.062	USD	Ribbit LEAP	294.107	0,07	594	USD	Viper Energy Partners	12.979	-
8.096	USD	Rice Acquisition II	83.389	0,02	11.246	USD	Western Alliance Bancorporation	1.223.790	0,30
582	USD	S&P Global	247.286	0,06	13.839	USD	Western Midstream Partners	290.065	0,07
2.752	USD	Sage Therapeutics	121.941	0,03	5.315	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	458.206	0,11
639	USD	Salesforce.com	173.310	0,04	20.166	USD	Whiting Petroleum	1.177.896	0,29
3.489	EUR	Schneider Electric	581.569	0,14	6.132	USD	Zions Bancorporation	379.509	0,09
2.980	USD	Seagen	506.004	0,12					
4.898	USD	Sempra Energy	619.597	0,15					
2.459	USD	Shoals Technologies Group	68.557	0,02	Vietnam			286.006	0,07
1.494	USD	Simon Property Group	194.175	0,05	131.240	VND	Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank	286.006	0,07
8.854	USD	Skyline Champion	531.771	0,13					
7.281	USD	SM Energy	192.073	0,05					
153	USD	SoFi Technologies	2.430	-					
688	USD	SolarEdge Technologies	182.471	0,04	Total Renta variable			154.928.656	37,64
8.466	USD	South Jersey Industries	179.987	0,04	Bonos				
408	USD	Square	97.855	0,02	Angola			414.112	0,10
3.985	USD	State Street	337.609	0,08	400.000	USD	Angolan Government International Bond 08/05/48, 9.38%	414.112	0,10
2.076	USD	Stryker	547.483	0,13					
7.604	USD	Sunlight Financial Holdings	40.377	0,01	Argentina			2.493.435	0,61
7.503	USD	Sustainable Development Acquisition I	73.229	0,02	241.475	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1.00%	92.946	0,02
1.618	CHF	Swiss Re	139.135	0,03	1.083.761	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0.50%	398.391	0,10
308	USD	Synaptics	55.357	0,01	4.354.510	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13%	1.426.145	0,34
30.767	USD	Synovus Financial	1.350.364	0,33	285.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50%	105.245	0,03
8.895	USD	Targa Resources	437.723	0,11	56.524	USD	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 25/07/27, 5.25%	29.953	0,01
5.232	USD	TCR2 Therapeutics	44.524	0,01	304.273	USD	Provincia de Cordoba 01/02/29, 5.00%	203.866	0,05
1.076	USD	Teleflex	405.168	0,10	305.000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	236.889	0,06
2.255	USD	Trimble	185.474	0,05					
3.511	USD	Triumph Bancorporation	351.556	0,09					
14.641	USD	United Community Banks	480.518	0,12					
527	USD	United Rentals	184.940	0,04					
4.785	USD	United States Steel	105.126	0,03					

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Austria			600.040	0,15
600.000	USD	Oesterreichische Kontrollbank 22/11/21, variable	600.040	0,15
Azerbaiyán			525.447	0,13
445.000	USD	Southern Gas Corridor 24/03/26, 6.88%	525.447	0,13
Benín			347.835	0,08
100.000	EUR	Benin Government International Bond 19/01/32, 4.88%	115.864	0,03
205.000	EUR	Benin Government International Bond 22/01/35, 4.95%	231.971	0,05
Canadá			317.755	0,08
400.000	CAD	Province of British Columbia Canada 18/12/21, 3.25%	317.755	0,08
China			1.102.390	0,27
200.000	USD	Bank of China 20/11/21, variable	200.108	0,05
500.000	USD	Bank of China 16/01/22, variable	500.367	0,12
200.000	USD	Bank of China 17/04/22, variable	200.265	0,05
200.000	USD	Industrial & Commercial Bank of China 21/02/22, 2.88%	201.650	0,05
Colombia			1.123.359	0,27
330.000	USD	Bancolombia 18/12/29, variable	334.698	0,08
460.000	USD	Colombia Government International Bond 30/01/30, 3.00%	433.787	0,10
380.000	USD	Colombia Government International Bond 22/04/32, 3.25%	354.874	0,09
Croacia			944.114	0,23
440.000	EUR	Croatia Government International Bond 17/06/31, 1.50%	534.087	0,13
345.000	EUR	Croatia Government International Bond 04/03/41, 1.75%	410.027	0,10
República Dominicana			602.966	0,15
260.000	USD	Dominican Republic International Bond 23/09/32, 4.88%	265.853	0,06
340.000	USD	Dominican Republic International Bond 21/01/41, 5.30%	337.113	0,09

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Egipto			1.225.251	0,30
9.035.000	EGP	Egypt Government Bond 06/07/26, 14.56%	580.418	0,14
230.000	USD	Egypt Government International Bond 16/02/26, 3.88%	216.790	0,05
230.000	USD	Egypt Government International Bond 29/05/32, 7.63%	229.960	0,06
225.000	USD	Egypt Government International Bond 16/02/61, 7.50%	198.083	0,05
Etiopía			226.319	0,05
260.000	USD	Ethiopia International Bond 11/12/24, 6.63%	226.319	0,05
Francia			700.045	0,17
600.000	EUR	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal perpetual, variable	700.045	0,17
Alemania			811.123	0,20
135.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	162.945	0,04
400.000	EUR	Vonovia Finance 28/01/41, 1.00%	418.747	0,10
200.000	EUR	Wintershall DeaFinance 2 Series NC8 perpetual, variable	229.431	0,06
Ghana			199.340	0,05
205.000	USD	Kosmos Energy 01/03/28, 7.50%	199.340	0,05
Honduras			156.752	0,04
150.000	USD	Honduras Government International Bond 24/06/30, 5.63%	156.752	0,04
Hungría			1.015.235	0,25
275.000	EUR	Hungary Government International Bond 28/04/32, 1.63%	336.544	0,08
395.000	EUR	Hungary Government International Bond 05/06/35, 1.75%	481.340	0,12
200.000	USD	Hungary Government International Bond 21/09/51, 3.13%	197.351	0,05
Costa de Marfil			498.665	0,12
100.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	113.125	0,03
330.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 22/03/48, 6.63%	385.540	0,09

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Luxemburgo			659.716	0,16
590.000	EUR	Altice Financing 15/01/25, 2.25%	659.716	0,16
México			819.849	0,20
500.000	EUR	America Movil 02/03/24, ZCP	601.424	0,15
250.000	USD	Petroleos Mexicanos 21/09/47, 6.75%	218.425	0,05
Marruecos			199.891	0,05
200.000	USD	OCP 23/06/31, 3.75%	199.891	0,05
Países Bajos			1.731.167	0,42
1.120.000	EUR	Aegon perpetual, variable	1.168.136	0,28
555.000	USD	VEON Holdings 25/11/27, 3.38%	563.031	0,14
Macedonia del Norte			542.014	0,13
270.000	EUR	North Macedonia Government International Bond 03/06/26, 3.68%	343.613	0,08
175.000	EUR	North Macedonia Government International Bond 10/03/28, 1.63%	198.401	0,05
Omán			198.547	0,05
200.000	USD	Oman Government International Bond 17/01/48, 6.75%	198.547	0,05
Rumanía			2.263.571	0,55
130.000	EUR	Romanian Government International Bond 02/12/29, 1.38%	148.179	0,04
150.000	EUR	Romanian Government International Bond 13/07/30, 1.75%	170.203	0,04
335.000	EUR	Romanian Government International Bond 16/07/31, 2.12%	388.067	0,09
147.000	EUR	Romanian Government International Bond 14/04/33, 2.00%	162.794	0,04
65.000	EUR	Romanian Government International Bond 08/02/38, 3.38%	78.359	0,02
250.000	EUR	Romanian Government International Bond 02/12/40, 2.63%	270.409	0,07
135.000	EUR	Romanian Government International Bond 14/04/41, 2.75%	145.647	0,04
745.000	EUR	Romanian Government International Bond 13/04/42, 2.88%	808.517	0,19
80.000	EUR	Romanian Government International Bond 28/01/50, 3.38%	91.396	0,02
Rusia			2.466.182	0,60
173.780.000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 23/03/33, 7.70%	2.466.182	0,60
Senegal			690.477	0,17
225.000	EUR	Senegal Government International Bond 13/03/28, 4.75%	271.827	0,07
365.000	EUR	Senegal Government International Bond 08/06/37, 5.38%	418.650	0,10
Serbia			458.762	0,11
360.000	EUR	Serbia International Bond 15/05/27, 3.13%	458.762	0,11
Sudáfrica			5.746.404	1,39
12.895.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/31, 7.00%	720.887	0,18
23.980.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	1.425.361	0,35
41.435.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	2.444.798	0,58
25.130.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/36, 6.25%	1.155.358	0,28
Corea del Sur			1.306.459	0,32
400.000	USD	Export-Import Bank of Korea 05/07/22, variable	402.033	0,10
200.000	USD	Korea Development Bank 27/02/22, variable	200.468	0,05
500.000	USD	Korea Development Bank 30/10/22, variable	503.496	0,12
200.000	USD	Korea Development Bank 18/02/23, variable	200.462	0,05
España			1.772.991	0,43
1.370.000	EUR	Cirsa Finance International Sarl 15/03/27, 4.50%	1.573.018	0,38
200.000	USD	Instituto de Credito Oficial 15/12/21, variable	199.973	0,05
Supranacional			6.927.485	1,67
127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.497.445	0,36
16.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	785.608	0,19
2.020.000	EUR	European Union 04/07/41, 0.45%	2.318.744	0,55
575.000	EUR	European Union 06/07/51, 0.70%	685.850	0,17

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
11.750.000	MXN	International Bank for Reconstruction & Development 25/05/33, ZCP	232.325	0,06
7.200.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	325.704	0,08
55.300.000	MXN	International Finance 29/01/36, ZCP	859.901	0,21
16.400.000	MXN	International Finance 22/02/38, ZCP	221.908	0,05
Suiza			654.106	0,16
665.000	USD	Julius Baer Group perpetual, variable	654.106	0,16
Turquía			207.916	0,05
250.000	USD	Turkey Government International Bond 11/05/47, 5.75%	207.916	0,05
Ucrania			736.547	0,18
200.000	USD	Ukraine Government International Bond 21/05/29, 6.88%	203.267	0,05
525.000	USD	Ukraine Government International Bond 15/03/33, 7.25%	533.280	0,13
Reino Unido			5.095.449	1,23
1.715.000	EUR	British American Tobacco perpetual, variable	1.976.637	0,47
1.030.000	GBP	CPUK Finance 28/08/27, 4.50%	1.415.881	0,34
200.000	GBP	Deuce Finco 15/06/27, 5.50%	273.244	0,07
290.000	GBP	Heathrow Funding 16/03/28, 2.63%	391.840	0,10
765.000	GBP	Wheel Bidco 15/07/26, 6.75%	1.037.847	0,25
Estados Unidos			1.299.420	0,32
580.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 13/08/41, 1.34%	646.275	0,16
650.000	USD	United States Treasury Note/Bond 31/12/21, 2.00%	653.145	0,16
Venezuela			39.240	0,01
360.000	USD	Venezuela Government International Bond 07/05/28, 9.25%*	39.240	0,01
Total Bonos			47.120.376	11,45
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			202.049.032	49,09

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Estados Unidos			666.910	0,16
36.900	USD	Archaea Energy	666.910	0,16
Total Renta variable			666.910	0,16
Bonos				
Azerbaiyán			153.318	0,04
150.000	USD	Republic of Azerbaijan International Bond 01/09/32, 3.50%	153.318	0,04
Brasil			199.250	0,05
200.000	USD	Centrais Eletricas Brasileiras 04/02/25, 3.63%	199.250	0,05
Canadá			5.056.753	1,23
250.000	CAD	Alberta Treasury Bill 12/10/21, ZCP	197.367	0,05
200.000	CAD	Alberta Treasury Bill 12/04/22, ZCP	157.703	0,04
200.000	CAD	Canadian Treasury Bill 14/10/21, ZCP	157.894	0,04
500.000	CAD	CDP Financial 03/11/21, ZCP	394.690	0,09
900.000	CAD	City of Montreal Canada 01/12/21, 4.50%	715.339	0,16
250.000	CAD	City of Montreal Canada 11/05/22, 0.25%	197.271	0,05
346.000	CAD	City of Quebec Canada 05/03/22, 1.65%	274.656	0,07
200.000	CAD	City of Toronto Canada 06/12/21, 3.50%	158.786	0,04
960.000	CAD	City of Vancouver 02/12/21, 3.45%	761.778	0,18
200.000	CAD	Hydro Quebec Interest Strip 16/01/22, ZCP	157.762	0,04
275.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 20/10/21, ZCP	217.095	0,05
345.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 03/11/21, ZCP	272.337	0,07
35.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 17/11/21, ZCP	27.627	0,01
200.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 07/10/21, ZCP	157.898	0,04
300.000	CAD	Nova Scotia Treasury Bill 05/10/21, ZCP	236.850	0,06
400.000	CAD	Ontario Treasury Bill 26/01/22, ZCP	315.593	0,08

* Valor sometido a impago.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
300.000	CAD	OPB Finance Trust 24/02/22, 1.88%	238.329	0,06
100.000	CAD	Province of British Columbia 28/01/22, ZCP	78.898	0,02
180.000	CAD	Province of British Columbia 26/04/22, ZCP	141.927	0,03
250.000	CAD	Province of British Columbia Canada Principal Strip 23/02/22, ZCP	196.953	0,05
China			1.172.634	0,28
250.000	USD	CNPC Finance 05/10/21, ZCP	249.993	0,06
550.000	USD	CNPC Finance 07/10/21, ZCP	549.972	0,13
455.000	USD	NIO 01/02/27, 0.50%	372.669	0,09
Egipto			809.755	0,20
12.775.000	EGP	Egypt Treasury Bill 12/10/21, ZCP	809.755	0,20
Japón			14.873.774	3,61
59.300.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 04/10/21, ZCP	532.823	0,13
26.050.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/10/21, ZCP	234.069	0,06
193.400.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 18/10/21, ZCP	1.737.811	0,42
65.400.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 25/10/21, ZCP	587.670	0,14
55.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 08/11/21, ZCP	494.239	0,12
165.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 15/11/21, ZCP	1.482.752	0,36
15.850.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 22/11/21, ZCP	142.439	0,03
195.800.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 29/11/21, ZCP	1.759.630	0,43
240.450.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 06/12/21, ZCP	2.160.946	0,53
164.250.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 13/12/21, ZCP	1.476.154	0,36
226.850.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 20/12/21, ZCP	2.038.784	0,50
194.200.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 06/01/22, ZCP	1.745.560	0,42
37.700.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 25/01/22, ZCP	338.871	0,08
15.800.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/02/22, ZCP	142.026	0,03
México			75.362	0,02
85.000	USD	Petroleos Mexicanos 02/06/41, 6.50%	75.362	0,02
Panamá			252.202	0,06
240.000	USD	Cable Onda 30/01/30, 4.50%	252.202	0,06

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Corea del Sur			399.982	0,10
400.000	USD	Korea Development Bank 07/11/21, variable	399.982	0,10
Taiwán			1.936.368	0,47
1.904.000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	1.936.368	0,47
Reino Unido			665.060	0,16
645.000	USD	Vodafone Group 04/06/81, variable	665.060	0,16
Estados Unidos			83.462.114	20,27
240.000	USD	Adams Homes 15/02/25, 7.50%	250.962	0,06
985.000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	970.225	0,24
1.238.000	USD	Avalara 01/08/26, 0.25%	1.277.084	0,31
1.760.000	USD	Community Health Systems 15/02/31, 4.75%	1.773.639	0,43
790.000	USD	Cornerstone Building Brands 15/01/29, 6.13%	840.363	0,20
465.000	USD	Cracker Barrel Old Country Store 15/06/26, 0.63%	471.103	0,11
890.000	USD	DISH DBS 01/07/28, 7.38%	948.918	0,23
590.000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	672.305	0,16
650.000	USD	IMAX 01/04/26, 0.50%	638.173	0,16
780.000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	768.178	0,19
1.369.000	USD	John Bean Technologies 15/05/26, 0.25%	1.454.562	0,35
30.000	USD	Rockcliff Energy II LLC 15/10/29, 5.50%	30.488	0,01
490.000	USD	Scripps Escrow II 15/01/31, 5.38%	482.466	0,12
510.000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	434.926	0,11
1.084.000	USD	Spirit Airlines 15/05/26, 1.00%	1.021.037	0,25
930.000	USD	Uber Technologies 15/12/25, ZCP	909.196	0,22
500.000	USD	United States Cash Management Bill 15/10/21, ZCP	499.988	0,12
3.483.000	USD	United States Cash Management Bill 01/11/21, ZCP	3.482.820	0,85
2.030.000	USD	United States Cash Management Bill 25/01/22, ZCP	2.029.715	0,49
5.831.000	USD	United States Treasury Bill 05/10/21, ZCP	5.830.975	1,42
325.000	USD	United States Treasury Bill 07/10/21, ZCP	324.997	0,08
1.498.000	USD	United States Treasury Bill 12/10/21, ZCP	1.497.974	0,36

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
1.995.000	USD	United States Treasury Bill 14/10/21, ZCP	1.994.978	0,48
7.970.000	USD	United States Treasury Bill 19/10/21, ZCP	7.969.791	1,94
7.734.000	USD	United States Treasury Bill 21/10/21, ZCP	7.733.744	1,88
8.539.000	USD	United States Treasury Bill 26/10/21, ZCP	8.538.692	2,07
6.107.000	USD	United States Treasury Bill 28/10/21, ZCP	6.106.773	1,48
5.540.000	USD	United States Treasury Bill 02/11/21, ZCP	5.539.705	1,35
9.840.000	USD	United States Treasury Bill 04/11/21, ZCP	9.839.514	2,39
200.000	USD	United States Treasury Bill 09/11/21, ZCP	199.986	0,05
2.700.000	USD	United States Treasury Bill 12/11/21, ZCP	2.699.858	0,66
410.000	USD	United States Treasury Bill 16/11/21, ZCP	409.978	0,10
1.205.000	USD	United States Treasury Bill 18/11/21, ZCP	1.204.906	0,29
750.000	USD	United States Treasury Bill 26/11/21, ZCP	749.965	0,18
500.000	USD	United States Treasury Bill 02/12/21, ZCP	499.971	0,12
500.000	USD	United States Treasury Bill 17/03/22, ZCP	499.896	0,12
1.500.000	USD	United States Treasury Bill 24/03/22, ZCP	1.499.652	0,36
1.365.000	USD	United States Treasury Bill 21/04/22, ZCP	1.364.611	0,33
Venezuela			13.200	-
220.000	USD	Petroleos de Venezuela 15/11/26, 6.00%*	13.200	-
Total Bonos			109.069.772	26,49
Valores a anunciar				
Estados Unidos			1.847.771	0,45
1.793.000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/51, 2.50%	1.847.771	0,45
Total Valores a anunciar			1.847.771	0,45
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			111.584.453	27,10

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Estados Unidos			60.110	0,01
7.200	USD	Payoneer	60.110	0,01
Total Renta variable			60.110	0,01
Total Otros valores			60.110	0,01

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Warrants	Valor de mercado en USD	% Patrimonio neto
Islas Caimán			10.297	-
15.800	USD	AEA-Bridges Impact Warrants 31/12/25	10.297	-
Estados Unidos			189.095	0,05
10.500	USD	Churchill Capital VI Warrants 31/12/27	12.600	-
10.900	USD	Climate Real Impact Solutions II Acquisition Warrants 31/12/27	11.445	-
8.800	USD	Cohn Robbins Holdings Warrants 28/08/25	7.964	-
11.600	USD	Constellation Acquisition I Warrants 31/12/27	7.843	-
48.000	USD	Fortistar Sustainable Solutions Warrants 31/12/27	32.760	0,02
1.400	USD	Hamilton Lane Alliance Holdings I Warrants 08/01/26	1.120	-
13.200	USD	Jaws Mustang Acquisition Warrants 30/01/26	15.180	0,01
17.000	USD	JOFF Fintech Acquisition Warrants 31/12/27	11.560	-
9.260	USD	Metals Acquisition Warrants 12/07/23	6.482	-
17.276	USD	Payoneer Global Warrants 31/12/27	32.824	0,02
18.700	USD	Pontem Warrants 31/12/27	13.427	-
7.865	USD	Ribbit LEAP Warrants 09/09/25	10.618	-
11.700	USD	RMG Acquisition III Warrants 31/12/27	10.647	-
22.500	USD	Sustainable Development Acquisition I Warrants 31/12/28	14.625	-
Total Warrants			199.392	0,05
Total Inversiones			313.892.987	76,25
Otros activos netos			97.786.509	23,75
Valor liquidativo			411.679.496	100,00

* Valor sometido a impago.

Las notas de las páginas 62 a 142 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021

La Sociedad

La Sociedad es una sociedad de inversión de capital variable constituida como "société anonyme" conforme a la legislación del Gran Ducado de Luxemburgo y cumple los requisitos para ser una Société d'Investissement à Capital Variable ("SICAV"). El objetivo exclusivo de la Sociedad consiste en colocar los subfondos que tiene a su disposición en todo tipo de valores mobiliarios y otros activos aptos, incluidos instrumentos financieros derivados, con el fin de diversificar los riesgos de inversión y gestionar las carteras en provecho de los Partícipes.

La estrategia de inversión de cada subfondo se basa en una estrategia de inversión alternativa diseñada por cada uno de los Gestores de inversiones y gestionada actualmente por estos.

Clases de Participaciones

Generalmente, las Participaciones se emitirán en la modalidad de Participaciones de acumulación. Solo se emitirán Participaciones de distribución de cualquier subfondo si así lo deciden los Consejeros. Los inversores pueden consultar a la Sociedad Gestora o a su Distribuidor acerca de la disponibilidad de Participaciones de distribución dentro de cada Clase de Participaciones y subfondo.

Los Consejeros podrán tomar la decisión de crear, dentro de cada subfondo, distintas Clases de Participaciones, cuyos activos se invertirán conjuntamente de acuerdo con la política de inversión específica del subfondo correspondiente, si bien cada una de dichas Clases de Participaciones podrá tener su propia estructura de comisiones, su propia divisa de denominación u otras características específicas. El Valor liquidativo por Participación se calculará por separado para cada Clase de Participaciones y podrá ser distinto para cada una de ellas como consecuencia de estos factores variables. Para obtener más información sobre las clases de participaciones disponibles en cada subfondo, consulte el folleto informativo vigente.

La Clase de Participaciones E no está disponible a través de la red mundial de distribuidores de Schroders. Si tiene cualquier duda al respecto, puede ponerse en contacto con la Sociedad Gestora.

Comisión de entrada

La Sociedad Gestora y los Distribuidores tienen derecho a percibir una comisión de entrada. No obstante, los Consejeros podrán acordar la renuncia parcial o total a la misma.

Clases de Participaciones	Comisión de entrada
Participaciones A ¹ , A2 y K	Hasta el 3,09278% del Valor liquidativo por Participación
Participaciones A1	Hasta el 2,04081% del Valor liquidativo por Participación
Participaciones C, C1, E y F	Hasta el 1,01010% del Valor liquidativo por Participación
Participaciones I, IF, N, R y X	Sin comisión de entrada

Comisión de distribución

A la fecha del presente informe, hay una comisión de distribución del 0,50% en todas las Clases de Participaciones A1 de Schroder GAIA. No existe ninguna otra comisión de distribución atribuible a otras clases de Participaciones disponibles para la inversión dentro de la Sociedad.

Ajuste por dilución

Un subfondo puede sufrir una dilución del Valor liquidativo por Participación debido a que inversores compren o vendan Participaciones en un subfondo a un precio que no refleje los costes de negociación y otros costes que se producen cuando el Gestor de inversiones realiza transacciones con valores para adaptar entradas y salidas de efectivo. Para contrarrestar este efecto, puede adoptarse un mecanismo de Ajuste por dilución con el fin de proteger los intereses de los Partícipes del subfondo. Si en un Día de valoración, el total de las transacciones netas en Participaciones de un subfondo supera un umbral predeterminado, según las determinaciones y las revisiones periódicas de la Sociedad Gestora para cada subfondo, el Valor liquidativo por Participación puede ajustarse al alza o a la baja para reflejar las entradas y las salidas netas, respectivamente.

El flujo neto será determinado por la Sociedad Gestora basándose en la última información disponible en el momento del cálculo del Valor liquidativo por Participación. El alcance del ajuste del precio será fijado por la Sociedad Gestora para reflejar los costes de negociación y otros costes. Dicho ajuste puede variar de subfondo a subfondo y no será superior al 2% del Valor liquidativo por Participación inicial.

El mecanismo se ha implementado para los subfondos Schroder GAIA desde su lanzamiento.

A 30 de septiembre de 2021, el último Día de cálculo del ejercicio analizado, se aplicó un ajuste por dilución a Schroder GAIA Cat Bond y Schroder GAIA Sirios US Equity. Los Valores liquidativos oficiales por Participación en cada uno de dichos subfondos tras la aplicación del ajuste por dilución en la fecha indicada figuran en la tabla siguiente. La información financiera restante que aparece en este informe se ofrece antes de aplicar ajustes por dilución.

¹ La comisión de entrada en la Clase de Participaciones A de Schroder GAIA Cat Bond asciende al 1,01010% del Valor liquidativo por Participación.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Ajuste por dilución (continuación)

	Divisa	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Sirios US Equity
Valor liquidativo por Participación* (incluido el ajuste por dilución)			
a 30 de septiembre de 2021			
Clase A Acum.	USD	1.469,49	151,80
Clase A Acum. CHF Cubierta	CHF	-	180,91
Clase A Acum. EUR Cubierta	EUR	-	136,43
Clase A Acum. SEK Cubierta	SEK	915,19	-
Clase C Acum.	USD	1.478,61	158,38
Clase C Acum. CHF Cubierta	CHF	1.162,20	187,04
Clase C Acum. EUR Cubierta	EUR	1.223,70	142,22
Clase C Acum. GBP Cubierta	GBP	105,05	148,06
Clase C Dist. GBP Cubierta	GBP	-	147,96
Clase E Acum.	USD	-	169,52
Clase E Acum. EUR Cubierta	EUR	-	152,52
Clase F Acum.	USD	1.468,51	-
Clase F Acum. CHF Cubierta	CHF	1.157,32	-
Clase F Acum. EUR Cubierta	EUR	1.215,87	-
Clase F Dist.	USD	1.175,04	-
Clase F Dist. SGD Cubierta	SGD	1.571,49	-
Clase I Acum.	USD	1.665,15	205,43
Clase I Acum. CHF Cubierta	CHF	1.409,76	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	EUR	1.486,42	-
Clase I Acum. JPY Cubierta	JPY	10.623,43	-
Clase IF Acum.	USD	1.516,18	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	CHF	1.283,37	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	EUR	1.353,34	-
Clase IF Acum. SEK Cubierta	SEK	923,96	-
Clase IF Dist.	USD	1.398,41	-
Clase X Acum.	USD	-	104,81
Clase X Acum. EUR Cubierta	EUR	-	150,92

* El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Importe mínimo de suscripción, importe mínimo de suscripción adicional e importe mínimo de participación

Subfondos	Clases de Participaciones	Suscripción inicial mínima	Suscripción adicional mínima	Participación mínima
Schroder GAIA BlueTrend	Participaciones A, C, E y N	10.000 USD	5.000 USD	10.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD
Schroder GAIA Cat Bond	Participaciones A, C y F	100.000 USD	50.000 USD	100.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD
	Participaciones IF	1.000.000 USD	500.000 USD	1.000.000 USD
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Participaciones A, A1, C y E	10.000 USD	5.000 USD	10.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD
Schroder GAIA Egerton Equity	Participaciones A, A1, C y E	10.000 EUR	5.000 EUR	10.000 EUR
	Participaciones I	5.000.000 EUR	2.500.000 EUR	5.000.000 EUR
	Participaciones X	100.000.000 EUR	2.500.000 EUR	100.000.000 EUR
Schroder GAIA Helix	Participaciones A, C y C1	10.000 USD	5.000 USD	10.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD
	Participaciones X	100.000.000 USD	2.500.000 USD	100.000.000 USD
Schroder GAIA Oaktree Credit*	Participaciones A2, C y E	10.000 USD	5.000 USD	10.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD
Schroder GAIA Sirios US Equity	Participaciones A, C y E	10.000 USD	5.000 USD	10.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD
	Participaciones X	100.000.000 USD	2.500.000 USD	100.000.000 USD
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Participaciones C y K	10.000 USD	5.000 USD	10.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	Participaciones C y K	10.000 GBP	5.000 GBP	10.000 GBP
	Participaciones I	5.000.000 GBP	2.500.000 GBP	5.000.000 GBP
	Participaciones R	Cero	Cero	Cero
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Participaciones A, A1, C, C1 y E	10.000 USD	5.000 USD	10.000 USD
	Participaciones I	5.000.000 USD	2.500.000 USD	5.000.000 USD

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Resumen de las políticas contables más importantes

Los estados financieros se preparan y presentan de conformidad con los principios contables generalmente aceptados en Luxemburgo para los fondos de inversión en funcionamiento. Los Subfondos que se han liquidado durante el ejercicio se preparan de conformidad con el principio de empresa en liquidación.

En la fecha del informe, el importe de efectivo mantenido en depósito correspondiente al subfondo liquidado Schroder GAIA M&A* era de 5.125 USD.

Valor liquidativo

Cálculo del Valor liquidativo por Participación

El Valor liquidativo por Participación de cada Clase de Participaciones se calcula el Día de cálculo en la divisa de la Clase de Participaciones pertinente. El cálculo se efectuará dividiendo el Valor liquidativo atribuible a cada Clase de Participaciones, siendo este el valor proporcional de su activo menos su pasivo, entre el número de Participaciones de dicha Clase que estén en circulación en ese momento. El importe resultante se redondeará hasta el cuarto decimal más cercano. En el folleto informativo vigente podrá encontrar más detalles sobre las normas que se aplican a la hora de valorar el patrimonio total.

Valoración de los activos de la Sociedad

El valor del efectivo en caja o en depósito, de letras y pagarés a la vista y de las cuentas por cobrar, los gastos abonados por adelantado, los dividendos en efectivo e intereses declarados o devengados como se ha mencionado anteriormente, pero que todavía no se hayan recibido, se considerará que es el importe total de los mismos, a no ser que en cualquiera de estos casos sea poco probable el pago o la recepción de la totalidad del mismo, en cuyo caso su valor se determinará tras realizar el descuento que la Sociedad considere adecuado para reflejar su valor real.

El valor de los valores, de los instrumentos financieros derivados y de los activos se determina tomando como base los precios de cierre del Día hábil en la bolsa o cualquier otro Mercado regulado en el que se negocien o coticen dichos valores o activos. Si un valor no se negocia ni está admitido a cotización oficial en bolsa ni en ningún Mercado regulado, o, en el caso de los valores cotizados o negociados, si el último precio disponible de los valores no refleja su valor real, los Consejeros deberán actuar en función del precio de venta esperado, que se determinará con prudencia y de buena fe.

Los instrumentos financieros derivados que no coticen en ninguna bolsa oficial ni se negocien en ningún otro mercado organizado están sujetos a una valoración fiable y verificable con una periodicidad diaria y pueden ser vendidos, liquidados o cerrados mediante una operación de compensación en cualquier momento a su valor razonable, a iniciativa de la Sociedad.

Si alguno de los principios de valoración antes mencionados no refleja el método de valoración que se utiliza comúnmente en mercados específicos, o si tales principios de valoración no parecen correctos para determinar el valor de los activos de la Sociedad, los Consejeros podrán fijar principios de valoración diferentes de buena fe y conforme a los principios y los procedimientos de valoración generalmente aceptados.

Las Participaciones o Acciones en OIC de tipo abierto se valorarán tomando como base el último Valor liquidativo disponible publicado por dicho OIC.

Ajuste de precios al valor razonable

El Consejo de Administración se reserva el derecho a aplicar el ajuste de precios al valor razonable cuando lo considere oportuno.

A 30 de septiembre de 2021, se aplicó el ajuste de la valoración razonable a los siguientes valores:

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

Fiscalidad

La Sociedad no está sujeta a ningún impuesto sobre la renta ni sobre las plusvalías en Luxemburgo.

El único impuesto al que la Sociedad está sujeta es la denominada "taxe d'abonnement", cuyo tipo es del 0,05% anual sobre el Valor liquidativo de cada subfondo al final del trimestre correspondiente y que se calcula y abona trimestralmente.

En el caso de cualquier Clase de Participaciones o subfondo que cuente exclusivamente con Inversores institucionales (conforme al significado de dicho término recogido en el Artículo 174 de la Ley de 17 de diciembre de 2010 en su versión modificada), el impuesto se gravará a un tipo del 0,01% anual.

Los ingresos por intereses y dividendos recibidos por la Sociedad pueden estar sujetos a una retención no recuperable en los países de origen. La Sociedad podrá estar sujeta a impuestos sobre la plusvalía materializada o latente de sus activos en los países de origen, y las disposiciones a este respecto pueden ser reconocidas en ciertas jurisdicciones.

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Comisiones de gestión

Los Gestores de inversiones tienen derecho a recibir por sus servicios unas comisiones de gestión que se calcularán y acumularán diariamente sobre la base del Valor liquidativo de los subfondos, y que se abonarán mensualmente. Las comisiones actuales pagaderas para el ejercicio analizado se reflejan en la siguiente tabla:

Subfondos	Clase de Participaciones	Comisión de gestión
Schroder GAIA BlueTrend	Participaciones A	1,60%
	Participaciones C, E y N	1,00%
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Cat Bond	Participaciones A y F	1,50%
	Participaciones C e IF	1,10%
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Participaciones A y A1	2,00%
	Participaciones C	1,25%
	Participaciones E	1,00%
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Egerton Equity	Participaciones A y A1	2,00%
	Participaciones C y E	1,25%
	Participaciones X (tipo efectivo)	hasta el 1,25% (1,25%)
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Helix	Participaciones A	2,00%
	Participaciones C y C1	1,00%
	Participaciones E	0,75%
	Participaciones X (tipo efectivo)	hasta el 1,00% (0,60%)
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA M&A*	Participaciones A	1,50%
	Participaciones C	0,75%
	Participaciones E	0,50%
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Oaktree Credit*	Participaciones A2	1,25%
	Participaciones C	0,75%
	Participaciones E	0,60%
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Sirios US Equity	Participaciones A	2,00%
	Participaciones C	1,25%
	Participaciones E	1,00%
	Participaciones X (tipo efectivo)	hasta el 1,25% (1,25%)
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Participaciones C	1,40%
	Participaciones K	1,90%
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	Participaciones C ¹ y R ²	0,75%
	Participaciones K ³	1,25%
	Participaciones I	Ninguna
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Participaciones A y A1	2,00%
	Participaciones C y C1	1,25%
	Participaciones E	0,75%
	Participaciones I	Ninguna

La Sociedad Gestora podrá, a su discreción, renunciar parcialmente a estas comisiones.

¹ el 1,00% hasta el 31 de octubre de 2020, el 0,75% desde el 1 de noviembre de 2020.

² el 1,00% hasta el 31 de diciembre de 2020, el 0,75% desde el 1 de enero de 2021.

³ el 1,50% hasta el 31 de octubre de 2020, el 1,25% desde el 1 de noviembre de 2020.

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Honorarios de los Consejeros

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini, Bernard Herman y Eric Bertrand recibieron una remuneración de 20.167 euros cada uno por el ejercicio analizado. Hugh Mullan recibió una remuneración de 16.000 euros por el ejercicio analizado. Los demás consejeros han renunciado a su remuneración.

Comisiones de rentabilidad

Se cobrará una comisión de rentabilidad en caso de que el incremento del Valor liquidativo por Participación durante el periodo de rentabilidad correspondiente supere la Cota máxima, es decir, el valor más alto del Valor liquidativo por Participación al final de cualquier periodo de rentabilidad previo (la Cota máxima).

La comisión de rentabilidad de una Clase de Participaciones se devenga en cada Día hábil y se incluye en los Valores liquidativos de los subfondos en el siguiente Día de cálculo, y se calcula a partir de la diferencia entre el Valor liquidativo por Participación determinado en el mismo Día de cálculo (antes de deducir toda provisión para comisiones de rentabilidad) y el umbral mínimo de rentabilidad, o bien, en el caso de utilizar una referencia, a partir de la diferencia entre dicho Valor liquidativo por Participación y la cifra que resulte mayor entre el Valor liquidativo objetivo por Participación (es decir, un Valor liquidativo por Participación hipotético que toma como base la rentabilidad del índice de referencia hasta el Día hábil) y la Cota máxima, diferencia que se multiplica, en ambos casos, por la media de Participaciones en circulación durante el ejercicio. No se calculan comisiones de rentabilidad para las Participaciones I.

En la siguiente tabla se muestran detalles de los cálculos de las comisiones de rentabilidad del ejercicio analizado. En el folleto informativo vigente podrá encontrar más detalles sobre el cálculo de las comisiones de rentabilidad y en la sección "Comisiones de rentabilidad por pagar" del Balance se muestran las comisiones por pagar del ejercicio. Las comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones durante el ejercicio se muestran en las páginas 141-142.

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

La comisión de rentabilidad para Schroder GAIA Contour Tech Equity, Schroder GAIA Egerton Equity, Schroder GAIA Two Sigma Diversified y Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund es del 20% de la rentabilidad superior.

La comisión de rentabilidad para Schroder GAIA Helix, Schroder GAIA M&A*, Schroder GAIA Sirios US Equity y Schroder GAIA Wellington Pagosa es del 20% de la rentabilidad superior (con la excepción de las Participaciones E, para las cuales el tipo es el 15% de la rentabilidad superior).

Para Schroder GAIA BlueTrend, la comisión de rentabilidad es del 10% de la rentabilidad superior.

Para Schroder GAIA Cat Bond y Schroder GAIA Oaktree Credit*, no se cobra ninguna comisión de rentabilidad.

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Comisiones del depositario y de administración

El Depositario y el Administrador del Fondo tienen derecho a recibir comisiones por los servicios relacionados proporcionados de conformidad con las prácticas comunes de Luxemburgo, pagaderas cada mes, del patrimonio neto del Fondo.

Reinversión de garantías en efectivo

Con el propósito de minimizar el riesgo de contraparte, los subfondos que realicen operaciones de cobertura de divisas vinculadas a Clases de Participaciones cubiertas abonarán o recibirán de la contraparte garantías en efectivo con una periodicidad diaria, lo que les permitirá reducir su exposición durante la vigencia del contrato a plazo.

Los Gestores de inversiones podrán reinvertir la garantía dineraria que reciben de la contraparte en relación con la cobertura de divisas.

Las garantías por cobrar o pagar al vencimiento de los contratos a plazo se indican en el Balance como "Garantías por cobrar/pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas". Las ampliaciones de garantía por cobrar o pagar se indican en el Balance como "Ampliaciones de garantía por cobrar/pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas".

Contratos de divisas a plazo

Los contratos de divisas a plazo existentes se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo sobre la base del tipo de cambio a plazo aplicable al vencimiento del contrato correspondiente. La plusvalía o minusvalía latente se muestra en el Balance bajo el apartado "Plusvalía/ (minusvalía) latente neta sobre contratos de divisas a plazo".

A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos estaban comprometidos con contratos de divisas a plazo existentes:

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend					
Cobertura de cartera					
AUD	10.700.000	USD	7.919.174	20-oct-2021	(183.075)
AUD	650.000	USD	472.884	27-oct-2021	(2.919)
BRL	49.948.121	USD	9.453.123	15-dic-2021	(396.316)
CAD	28.560.970	USD	22.619.460	20-oct-2021	(70.741)
CAD	810.000	USD	637.241	27-oct-2021	2.244
CLP	360.953.658	USD	454.301	15-dic-2021	(12.119)
CNH	83.630	USD	12.916	08-oct-2021	50
CNH	171.680	USD	26.517	12-oct-2021	91
CNH	153.394.476	USD	23.695.727	20-oct-2021	62.589
CNH	104.008.654	USD	16.009.439	17-nov-2021	63.312
EUR	13.100.000	USD	15.451.578	20-oct-2021	(272.411)
EUR	400.000	USD	468.992	27-oct-2021	(5.444)
GBP	16.100.000	USD	22.252.869	20-oct-2021	(559.318)
GBP	300.000	USD	404.638	27-oct-2021	(406)
HUF	3.542.226.218	USD	12.055.617	20-oct-2021	(645.557)
IDR	263.886.958.901	USD	18.160.747	15-dic-2021	142.499
INR	2.744.532.174	USD	36.708.957	15-dic-2021	(15.143)
JPY	1.880.577.750	USD	17.164.947	20-oct-2021	(265.827)
JPY	55.485.000	USD	500.169	27-oct-2021	(1.549)
KRW	3.327.828.403	USD	2.867.974	15-dic-2021	(60.344)
MXN	766.558.305	USD	38.267.332	20-oct-2021	(1.227.517)
NOK	72.430.721	USD	8.373.235	20-oct-2021	(88.656)
NZD	22.900.000	USD	16.233.440	20-oct-2021	(425.848)
PHP	191.865.107	USD	3.816.174	15-dic-2021	(64.744)
PLN	14.016.796	USD	3.662.322	20-oct-2021	(138.173)
RUB	1.552.927.746	USD	20.949.913	15-dic-2021	87.072
SEK	130.343.690	USD	15.191.184	20-oct-2021	(300.468)
SGD	17.107.383	USD	12.743.370	20-oct-2021	(144.439)
SGD	2.500.000	USD	1.847.357	27-oct-2021	(6.227)
THB	63.292.041	USD	1.886.025	20-oct-2021	(15.655)
THB	3.877.462	USD	115.660	27-oct-2021	(1.080)
TWD	334.188.782	USD	12.134.785	15-dic-2021	(139.495)
USD	34.244.038	AUD	46.607.074	20-oct-2021	547.128
USD	5.097.099	AUD	7.035.000	27-oct-2021	10.633
USD	140.292	AUD	192.926	15-jun-2022	688
USD	69.322	BRL	368.496	27-oct-2021	1.906

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)						
USD	12.040.748	BRL	65.334.300	15-dic-2021	194.050	
USD	21.545.015	CAD	27.420.224	20-oct-2021	(103.090)	
USD	1.807.088	CAD	2.290.000	27-oct-2021	(839)	
USD	312.735	CHF	290.000	27-oct-2021	1380	
USD	15.698.164	CLP	12.372.397.962	15-dic-2021	541.483	
USD	12.923	CNH	83.630	08-oct-2021	(43)	
USD	26.533	CNH	171.680	12-oct-2021	(76)	
USD	23.636.934	CNH	153.394.476	20-oct-2021	(121.384)	
USD	458	CNH	2.974	17-nov-2021	(1)	
USD	10.521	CZK	230.000	27-oct-2021	16	
USD	29.119.953	EUR	24.700.000	20-oct-2021	499.694	
USD	10.521.551	EUR	9.005.000	27-oct-2021	85.932	
USD	30.548.875	GBP	22.300.000	20-oct-2021	501.280	
USD	1.726.132	GBP	1.275.000	27-oct-2021	8.146	
USD	303.263	HKD	2.360.000	27-oct-2021	79	
USD	17.318.515	HUF	5.237.478.194	20-oct-2021	447.784	
USD	6.897	HUF	2.125.000	27-oct-2021	53	
USD	1.285.492	IDR	18.747.476.467	15-dic-2021	(14.836)	
USD	16.166.612	INR	1.204.158.769	15-dic-2021	67.265	
USD	58.467.884	JPY	6.448.353.587	20-oct-2021	522.129	
USD	1.356.310	JPY	151.205.000	27-oct-2021	(2.502)	
USD	1.125.610	KRW	1.329.318.841	27-oct-2021	3.349	
USD	17.077.447	KRW	20.035.430.256	15-dic-2021	173.905	
USD	21.715.808	MXN	440.349.651	20-oct-2021	438.275	
USD	7.331.671	NOK	63.907.983	20-oct-2021	21.917	
USD	18.644.503	NZD	26.700.000	20-oct-2021	213.817	
USD	31.173	NZD	45.000	27-oct-2021	112	
USD	7.175.326	PHP	366.393.184	15-dic-2021	11.444	
USD	22.353.236	PLN	86.688.306	20-oct-2021	557.776	
USD	35.426	PLN	140.000	27-oct-2021	227	
USD	1.601.510	RUB	118.836.212	15-dic-2021	(8.323)	
USD	19.852.660	SEK	172.273.434	20-oct-2021	171.810	
USD	244.076	SEK	2.130.000	27-oct-2021	729	
USD	24.305.607	SGD	32.902.200	20-oct-2021	74.399	
USD	2.306.619	SGD	3.130.000	27-oct-2021	1.525	
USD	16.677.942	THB	545.973.788	20-oct-2021	543.643	
USD	291.120	TRY	2.625.000	27-oct-2021	(447)	
USD	19.297.305	TWD	536.396.572	15-dic-2021	44.019	
USD	10.272.842	ZAR	152.775.071	20-oct-2021	150.339	
USD	1.078.128	ZAR	16.300.000	27-oct-2021	(843)	
ZAR	190.753.018	USD	13.250.188	20-oct-2021	(611.358)	
					USD	287.576
Cobertura de las Clases de Participaciones						
BRL	139.171.088	USD	26.301.670	29-oct-2021	(847.760)	
CHF	400.784	USD	434.217	29-oct-2021	(3.899)	
EUR	57.727.328	USD	67.700.485	29-oct-2021	(799.570)	
GBP	49.585.985	USD	67.717.430	29-oct-2021	(903.104)	
SGD	14.126	USD	10.477	29-oct-2021	(74)	

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)					
USD	380	GBP	281	29-oct-2021	2
					USD (2.554.405)
					USD (2.266.829)
Schroder GAIA Cat Bond					
Cobertura de cartera					
USD	88.929.979	EUR	75.100.000	26-nov-2021	1.846.611
					USD 1.846.611
Cobertura de las Clases de Participaciones					
CHF	213.751.561	USD	231.595.761	29-oct-2021	(2.092.472)
EUR	678.745.043	USD	796.019.281	29-oct-2021	(9.413.244)
GBP	10.441	USD	14.257	29-oct-2021	(189)
JPY	1.265.657	USD	11.517	29-oct-2021	(143)
SEK	6.230.076.294	USD	720.474.917	29-oct-2021	(8.694.457)
SGD	747.326	USD	554.301	29-oct-2021	(3.935)
USD	1.548.240	CHF	1.431.529	29-oct-2021	11.221
USD	4.330.072	EUR	3.692.004	29-oct-2021	51.364
USD	70	GBP	52	29-oct-2021	1
USD	47	JPY	5.191	29-oct-2021	1
USD	5.435.433	SEK	46.988.582	29-oct-2021	67.031
USD	4.383	SGD	5.908	29-oct-2021	32
					USD (20.074.790)
					USD (18.228.179)
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Cobertura de cartera					
AUD	2.893.887	USD	2.111.888	12-nov-2021	(19.402)
EUR	8.156.468	USD	9.589.024	12-nov-2021	(133.764)
GBP	3.069.115	USD	4.229.983	12-nov-2021	(94.513)
JPY	716.467.229	USD	6.512.269	12-nov-2021	(72.969)
NOK	99.504.350	USD	11.389.225	12-nov-2021	(10.107)
USD	2.000.101	AUD	2.744.860	12-nov-2021	15.372
USD	7.783.909	EUR	6.626.713	12-nov-2021	101.994
USD	5.752.765	GBP	4.201.098	12-nov-2021	92.006
USD	5.407.505	JPY	596.072.864	12-nov-2021	50.258
USD	9.109.117	NOK	80.004.590	12-nov-2021	(40.047)
					USD (111.172)
Cobertura de las Clases de Participaciones					
CHF	4.862.870	USD	5.268.736	29-oct-2021	(47.514)
EUR	121.325.138	USD	142.281.343	29-oct-2021	(1.676.137)
GBP	29.042.078	USD	39.657.237	29-oct-2021	(524.669)
SEK	160.722.810	USD	18.586.632	29-oct-2021	(224.199)
SGD	1.012.945	USD	751.316	29-oct-2021	(5.335)
USD	57.978	CHF	54.195	29-oct-2021	(210)
USD	1.516.078	EUR	1.307.033	29-oct-2021	1.342
USD	470.239	GBP	349.626	29-oct-2021	(862)
USD	190.587	SEK	1.676.011	29-oct-2021	(896)
USD	8.715	SGD	11.861	29-oct-2021	(20)
					USD (2.478.500)
					USD (2.589.672)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Egerton Equity					
Cobertura de cartera					
CHF	4.749.000	EUR	4.372.566	15-oct-2021	26.896
CNY	113.289.000	EUR	14.798.187	18-oct-2021	317.400
EUR	3.056.580	BRL	18.941.000	18-oct-2021	61.946
EUR	58.182.061	CAD	87.148.000	15-oct-2021	(1.202.479)
EUR	15.270.831	DKK	113.582.000	15-oct-2021	(2.292)
EUR	11.562.712	HKD	106.290.000	15-oct-2021	(222.406)
EUR	5.703.701	IDR	96.774.759.000	18-oct-2021	(123.505)
EUR	9.600.605	INR	841.109.000	18-oct-2021	(163.638)
EUR	6.475.723	JPY	839.106.000	15-oct-2021	(32.154)
EUR	7.202.962	RUB	625.887.000	15-oct-2021	(203.455)
EUR	3.086.133	SEK	31.443.000	15-oct-2021	(14.133)
EUR	4.347.799	SGD	6.905.000	15-oct-2021	(41.370)
EUR	731.626.317	USD	864.914.000	15-oct-2021	(14.886.946)
GBP	12.487.000	EUR	14.611.172	15-oct-2021	(89.260)
HKD	31.059.000	EUR	3.416.384	15-oct-2021	27.345
USD	30.933.000	EUR	26.323.714	15-oct-2021	374.773
					EUR (16.173.278)
Cobertura de las Clases de Participaciones					
EUR	303.473	GBP	262.266	29-oct-2021	(1.459)
EUR	1.754.093	USD	2.034.272	29-oct-2021	(1.235)
GBP	47.438.431	EUR	55.253.066	29-oct-2021	(97.423)
USD	359.651.708	EUR	306.680.176	29-oct-2021	3.655.205
					EUR 3.555.088
					EUR (12.618.190)
Schroder GAIA Helix					
Cobertura de cartera					
AUD	16.350.000	USD	12.019.558	28-oct-2021	(198.083)
AUD	14.776.000	USD	10.878.790	18-nov-2021	(194.447)
BRL	1.190.000	USD	226.108	04-oct-2021	(7.589)
CAD	14.351.000	USD	11.403.589	28-oct-2021	(73.665)
CHF	19.180.000	EUR	17.684.965	28-oct-2021	97.979
CHF	31.641.000	USD	34.473.660	28-oct-2021	(501.780)
CLP	164.700.000	USD	219.723	14-oct-2021	(16.783)
DKK	13.689.000	EUR	1.840.434	28-oct-2021	334
DKK	64.137.000	USD	10.165.713	28-oct-2021	(171.060)
EUR	3.556.162	CHF	3.836.000	28-oct-2021	2.619
EUR	1.031.722	DKK	7.674.000	28-oct-2021	(209)
EUR	126.807	GBP	108.000	28-oct-2021	1.432
EUR	581.422	NOK	6.073.000	28-oct-2021	(20.779)
EUR	8.374.142	SEK	85.511.000	28-oct-2021	(64.769)
EUR	190.000	USD	225.514	12-oct-2021	(5.392)
EUR	75.972.251	USD	89.563.863	28-oct-2021	(1.520.311)
GBP	8.583.432	EUR	10.028.257	28-oct-2021	(55.977)
GBP	51.676.128	USD	71.163.197	28-oct-2021	(1.532.612)
GBP	1.893.000	USD	2.626.099	18-nov-2021	(75.388)
HKD	1.402.021.000	USD	180.370.998	28-oct-2021	(256.148)
JPY	4.983.437.260	USD	45.172.813	28-oct-2021	(388.554)
KRW	132.880.000	USD	114.639	12-oct-2021	(2.426)
MXN	2.310.000	USD	115.126	12-oct-2021	(3.383)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Helix (continuación)						
NOK	57.842.000	EUR	5.588.602	28-oct-2021	138.956	
NOK	99.392.876	USD	11.324.865	28-oct-2021	42.952	
NZD	944.000	USD	658.683	28-oct-2021	(7.082)	
NZD	2.233.000	USD	1.568.480	18-nov-2021	(27.408)	
PEN	615.000	USD	150.588	12-nov-2021	(1.997)	
RUB	8.495.000	USD	115.907	12-oct-2021	628	
SEK	215.338.000	EUR	21.056.614	28-oct-2021	199.678	
SEK	226.287.123	USD	26.089.337	28-oct-2021	(236.425)	
SGD	16.796.000	USD	12.391.201	28-oct-2021	(21.784)	
SGD	9.099.000	USD	6.722.592	18-nov-2021	(21.952)	
USD	298.792	AUD	405.000	28-oct-2021	5.967	
USD	787.074	AUD	1.100.000	18-nov-2021	(8.322)	
USD	223.499	BRL	1.190.000	04-oct-2021	4.980	
USD	110.089	BRL	595.000	02-dic-2021	1.927	
USD	197.126	CAD	246.000	28-oct-2021	2.913	
USD	2.348.206	CHF	2.147.000	28-oct-2021	43.044	
USD	801	CNH	5.184	08-oct-2021	(3)	
USD	16.273	DKK	103.000	28-oct-2021	223	
USD	224.657	EUR	190.000	12-oct-2021	4.534	
USD	53.441.677	EUR	45.453.203	28-oct-2021	766.369	
USD	43.116.388	GBP	31.221.855	28-oct-2021	1.046.752	
USD	341.442	GBP	250.000	18-nov-2021	4.581	
USD	33.626.982	HKD	261.593.000	28-oct-2021	20.648	
USD	5.381.960	JPY	590.691.344	28-oct-2021	73.641	
USD	222.727	KRW	254.635.000	12-oct-2021	7.697	
USD	223.846	MXN	4.525.000	12-oct-2021	4.955	
USD	4.911.278	NOK	43.259.969	28-oct-2021	(36.475)	
USD	111.863	RUB	8.495.000	12-oct-2021	(4.672)	
USD	18.838.458	SEK	162.625.936	28-oct-2021	258.725	
USD	1.681.808	SGD	2.264.000	28-oct-2021	14.485	
					USD	(2.709.456)
Cobertura de las Clases de Participaciones						
CHF	6.021.496	USD	6.523.073	29-oct-2021	(57.841)	
EUR	243.478.667	USD	285.543.470	29-oct-2021	(3.373.029)	
GBP	133.684.971	USD	181.836.459	29-oct-2021	(1.703.478)	
JPY	1.331.342	USD	12.115	29-oct-2021	(151)	
SGD	49.623	USD	36.806	29-oct-2021	(261)	
USD	17.482	CHF	16.157	29-oct-2021	134	
USD	1.530.977	EUR	1.306.050	29-oct-2021	17.378	
USD	509.359	GBP	373.541	29-oct-2021	6.034	
USD	14	JPY	1.527	29-oct-2021	-	
USD	362	SGD	488	29-oct-2021	2	
					USD	(5.111.212)
					USD	(7.820.668)
Schroder GAIA Oaktree Credit*						
Cobertura de cartera						
AUD	823	USD	608	20-oct-2021	(12)	
EUR	534.652	USD	631.646	20-oct-2021	(12.136)	
USD	397.335	AUD	534.000	20-oct-2021	11.253	

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Oaktree Credit* (continuación)						
USD	7.684.180	EUR	6.497.580	20-oct-2021	155.337	
USD	1.138.080	GBP	824.525	20-oct-2021	27.094	
					USD	181.536
Cobertura de las Clases de Participaciones						
CHF	1.599.182	USD	1.732.660	29-oct-2021	(15.630)	
EUR	1.901.789	USD	2.230.383	29-oct-2021	(26.376)	
GBP	20.347	USD	27.784	29-oct-2021	(368)	
					USD	(42.374)
					USD	139.162
Schroder GAIA Sirios US Equity						
Cobertura de cartera						
EUR	2.916.000	USD	3.422.971	15-dic-2021	(39.944)	
GBP	637.000	USD	867.423	15-dic-2021	(9.022)	
USD	26.208.818	EUR	22.216.000	15-dic-2021	434.701	
USD	21.584.055	GBP	15.685.000	15-dic-2021	447.463	
USD	4.063.672	SEK	35.045.000	15-dic-2021	57.677	
					USD	890.875
Cobertura de las Clases de Participaciones						
CHF	3.859.382	USD	4.181.547	29-oct-2021	(37.761)	
EUR	92.148.927	USD	108.070.629	29-oct-2021	(1.278.098)	
GBP	9.899.379	USD	13.517.882	29-oct-2021	(179.025)	
USD	62.541	CHF	58.085	29-oct-2021	175	
USD	3.308.673	EUR	2.836.756	29-oct-2021	21.121	
USD	203.880	GBP	150.610	29-oct-2021	940	
					USD	(1.472.648)
					USD	(581.773)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified						
Cobertura de cartera						
AUD	20.088.548	USD	14.755.332	15-dic-2021	(227.143)	
BRL	28.464.106	USD	5.469.470	08-oct-2021	(246.732)	
BRL	28.464.106	USD	5.224.967	01-nov-2021	(21.253)	
CAD	29.651.782	USD	23.414.749	15-dic-2021	(4.603)	
CHF	25.705.752	USD	28.070.251	15-dic-2021	(434.622)	
CNH	34.265.420	USD	5.263.097	15-dic-2021	20.178	
CZK	32.193.959	USD	1.501.282	15-dic-2021	(33.176)	
EUR	40.000.000	USD	47.006.214	15-dic-2021	(599.809)	
GBP	43.474.175	USD	60.188.546	15-dic-2021	(1.604.171)	
HUF	460.828.765	USD	1.566.207	15-dic-2021	(84.782)	
ILS	6.982.324	USD	2.184.073	15-dic-2021	(16.773)	
INR	371.869.571	USD	5.077.238	07-oct-2021	(68.965)	
INR	371.869.571	USD	5.007.670	29-oct-2021	(12.371)	
JPY	2.834.550.500	USD	25.849.630	15-dic-2021	(363.798)	
KRW	1.170.824.680	USD	1.004.000	15-dic-2021	(16.196)	
MXN	192.527.317	USD	9.535.252	15-dic-2021	(307.369)	
NOK	18.798.100	USD	2.171.288	15-dic-2021	(22.231)	
NZD	14.947.081	USD	10.590.162	15-dic-2021	(277.435)	
PLN	33.643.616	USD	8.845.714	15-dic-2021	(388.741)	
RUB	306.532.773	USD	4.164.536	04-oct-2021	46.585	
RUB	147.313.052	USD	2.008.933	22-oct-2021	8.133	

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)						
RUB	159.219.721	USD	2.179.689	28-oct-2021	(2.037)	
SEK	16.365.651	USD	1.879.793	15-dic-2021	(9.035)	
SGD	10.741.310	USD	8.002.430	15-dic-2021	(92.881)	
TWD	3.409.000	USD	122.626	07-oct-2021	(268)	
USD	9.734.193	AUD	13.194.668	15-dic-2021	191.710	
USD	5.241.574	BRL	28.464.106	08-oct-2021	18.837	
USD	57.790.381	CAD	72.816.990	15-dic-2021	301.213	
USD	18.478.272	CHF	17.004.739	15-dic-2021	196.889	
USD	1.804.421	CNH	11.729.000	15-dic-2021	(4.036)	
USD	1.156.048	CZK	25.467.500	15-dic-2021	(5.319)	
USD	131.853.776	EUR	111.000.000	15-dic-2021	3.076.004	
USD	18.706.343	GBP	13.739.880	15-dic-2021	190.932	
USD	2.385.827	HUF	700.763.512	15-dic-2021	133.085	
USD	596.698	ILS	1.908.000	15-dic-2021	4.459	
USD	5.018.483	INR	371.869.571	07-oct-2021	10.211	
USD	5.000.000	INR	372.450.000	29-oct-2021	(3.095)	
USD	77.527.851	JPY	8.522.508.377	15-dic-2021	900.812	
USD	11.014.312	KRW	12.786.901.926	15-dic-2021	226.226	
USD	7.044.055	MXN	142.182.410	15-dic-2021	229.217	
USD	8.708.927	NOK	75.551.172	15-dic-2021	71.683	
USD	4.047.478	PLN	15.810.586	15-dic-2021	73.182	
USD	4.204.114	RUB	306.532.773	04-oct-2021	(7.007)	
USD	2.000.000	RUB	147.313.052	22-oct-2021	(17.066)	
USD	4.666.719	SEK	39.944.603	15-dic-2021	100.649	
USD	3.546.279	SGD	4.796.873	15-dic-2021	14.020	
USD	123.403	TWD	3.409.000	07-oct-2021	1.045	
USD	122.829	TWD	3.409.000	01-nov-2021	474	
USD	227.015	TWD	6.252.435	15-dic-2021	2.591	
USD	550.235	ZAR	7.959.511	15-dic-2021	27.037	
ZAR	27.635.984	USD	1.909.603	15-dic-2021	(93.023)	
					USD	881.235
Cobertura de las Clases de Participaciones						
CHF	3.244.182	USD	3.515.010	29-oct-2021	(31.759)	
EUR	191.268.509	USD	224.316.073	29-oct-2021	(2.652.630)	
GBP	217.158.222	USD	296.534.112	29-oct-2021	(3.925.619)	
USD	68.905	CHF	63.995	29-oct-2021	195	
USD	4.954.861	EUR	4.250.444	29-oct-2021	28.970	
USD	5.696.838	GBP	4.217.346	29-oct-2021	14.201	
					USD	(6.566.642)
					USD	(5.685.407)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
Cobertura de las Clases de Participaciones						
CHF	213.990	GBP	169.764	29-oct-2021	752	
EUR	18.596.715	GBP	15.967.380	29-oct-2021	27.330	
GBP	1.083	CHF	1.370	29-oct-2021	(8)	
GBP	145.770	EUR	169.594	29-oct-2021	(94)	
GBP	38.198	USD	52.308	29-oct-2021	(621)	
USD	3.126.906	GBP	2.290.008	29-oct-2021	30.614	
					GBP	57.973

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Cobertura de cartera					
AUD	21.392.000	USD	15.638.666	06-oct-2021	(173.191)
AUD	698.000	USD	511.841	22-oct-2021	(7.182)
AUD	5.750.000	USD	4.153.907	04-nov-2021	3.621
AUD	1.045.000	USD	767.263	15-dic-2021	(11.511)
BRL	60.838.000	USD	11.541.679	04-oct-2021	(370.031)
BRL	24.373.000	USD	4.509.594	03-nov-2021	(55.097)
BRL	1.598.000	USD	302.480	12-nov-2021	(10.910)
BRL	27.845.000	USD	5.241.112	02-dic-2021	(179.293)
BRL	4.777.000	USD	874.092	10-mar-2022	(23.684)
BRL	6.344.000	USD	1.157.136	14-mar-2022	(28.763)
BRL	5.910.000	USD	1.060.565	14-jul-2022	(38.993)
CAD	9.854.112	USD	7.794.080	06-oct-2021	(14.145)
CAD	717.000	USD	574.144	07-oct-2021	(8.065)
CAD	215.000	USD	169.058	04-nov-2021	680
CAD	2.465.000	USD	1.948.119	15-dic-2021	(1.996)
CHF	1.597.800	USD	1.733.963	06-oct-2021	(19.401)
CHF	1.218.000	USD	1.334.437	15-dic-2021	(24.995)
CLP	9.640.331.000	USD	12.155.731	06-oct-2021	(267.946)
CLP	773.356.000	USD	1.100.863	29-oct-2021	(149.487)
CLP	1.434.500.000	USD	1.781.103	04-nov-2021	(17.496)
CLP	1.560.500.000	USD	1.974.299	15-dic-2021	(62.625)
CLP	723.204.000	USD	958.521	24-dic-2021	(73.283)
CLP	247.298.000	USD	337.378	30-dic-2021	(34.836)
CLP	249.646.000	USD	321.295	14-feb-2022	(17.109)
CLP	393.981.000	USD	487.902	14-mar-2022	(9.019)
CNH	155.775.853	USD	24.056.072	08-oct-2021	95.140
CNH	2.125.000	USD	323.859	29-oct-2021	5.020
CNH	2.150.000	USD	332.884	06-dic-2021	(1.136)
CNH	30.252.000	USD	4.650.077	15-dic-2021	14.382
CNY	3.171.000	USD	490.260	08-oct-2021	323
CNY	115.360.000	USD	17.794.780	04-nov-2021	15.632
COP	12.163.174.000	USD	3.180.710	06-oct-2021	13.123
COP	2.716.300.000	USD	710.821	04-nov-2021	895
COP	11.409.900.000	USD	2.961.427	15-dic-2021	20.093
CZK	232.680.000	USD	10.818.761	06-oct-2021	(183.461)
CZK	33.620.000	USD	1.528.745	04-nov-2021	6.414
CZK	53.631.000	USD	2.489.845	15-dic-2021	(44.170)
DKK	484.000	USD	76.284	29-oct-2021	(860)
EGP	5.620.000	USD	341.019	12-oct-2021	15.604
EGP	23.726.000	USD	1.476.332	15-dic-2021	2.025
EUR	14.554.000	USD	17.105.588	06-oct-2021	(246.262)
EUR	707.000	USD	835.384	08-oct-2021	(16.363)
EUR	461.000	USD	547.207	14-oct-2021	(13.100)
EUR	3.072.000	USD	3.582.505	29-oct-2021	(22.327)
EUR	2.624.000	USD	3.052.800	04-nov-2021	(11.461)
EUR	8.204.000	USD	9.661.403	15-dic-2021	(143.451)
EUR	487.000	USD	569.060	10-ene-2022	(3.655)
GBP	15.836.000	USD	21.630.865	06-oct-2021	(293.407)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
GBP	298.000	USD	401.331	29-oct-2021	207
GBP	274.000	USD	387.984	13-dic-2021	(18.757)
GBP	3.562.000	USD	4.903.316	15-dic-2021	(103.281)
GBP	209.000	USD	285.886	22-dic-2021	(4.228)
GBP	236.000	USD	319.808	31-mar-2022	(1.841)
HKD	7.350.000	USD	944.595	06-oct-2021	(423)
HUF	2.925.228.000	USD	9.786.396	06-oct-2021	(359.052)
HUF	2.143.400.000	USD	6.992.464	29-oct-2021	(90.432)
HUF	1.475.632.000	USD	4.944.387	15-dic-2021	(200.679)
HUF	2.143.400.000	USD	7.086.565	29-jul-2022	(273.546)
IDR	56.905.000.000	USD	3.988.417	06-oct-2021	(13.375)
IDR	48.521.000.000	USD	3.384.438	04-nov-2021	(4.905)
IDR	79.339.000.000	USD	5.516.374	15-dic-2021	(13.409)
ILS	36.598.820	USD	11.409.336	06-oct-2021	(57.049)
ILS	235.000	USD	73.136	04-nov-2021	(229)
ILS	3.415.000	USD	1.067.617	15-dic-2021	(7.608)
INR	1.282.387.000	USD	17.481.907	06-oct-2021	(209.123)
INR	923.657.000	USD	12.400.577	03-nov-2021	(624)
INR	96.891.000	USD	1.303.788	15-dic-2021	(8.376)
JPY	1.339.727.470	USD	12.028.238	06-oct-2021	9.559
JPY	342.500.000	USD	3.064.781	04-nov-2021	13.284
JPY	305.000.000	USD	2.775.130	15-dic-2021	(32.833)
KRW	10.226.830.000	USD	8.631.541	06-oct-2021	5.651
KRW	107.000.000	USD	90.152	04-nov-2021	168
KRW	1.410.057.000	USD	1.211.025	17-nov-2021	(21.010)
KRW	528.190.000	USD	453.320	15-dic-2021	(7.695)
KZT	60.700.000	USD	139.332	15-dic-2021	506
MXN	379.653.996	USD	18.860.150	06-oct-2021	(474.522)
MXN	259.389.000	USD	12.580.228	04-nov-2021	(73.032)
MXN	106.900.000	USD	5.259.854	15-dic-2021	(136.111)
NOK	131.913.000	USD	15.074.408	06-oct-2021	15.343
NOK	10.760.000	USD	1.230.532	04-nov-2021	50
NZD	10.545.000	USD	7.453.159	06-oct-2021	(173.495)
NZD	752.000	USD	519.399	22-oct-2021	(309)
NZD	4.030.000	USD	2.778.322	04-nov-2021	3.284
NZD	700.000	USD	495.116	15-dic-2021	(12.151)
PEN	14.615.000	USD	3.578.176	06-oct-2021	(43.470)
PEN	10.240.000	USD	2.476.720	04-nov-2021	(1.914)
PEN	14.155.000	USD	3.439.374	15-dic-2021	(24.912)
PHP	117.670.000	USD	2.337.608	06-oct-2021	(30.948)
PHP	142.450.000	USD	2.789.368	15-dic-2021	(4.122)
PLN	34.088.916	USD	8.672.524	06-oct-2021	(101.577)
PLN	4.945.000	USD	1.245.702	04-nov-2021	(2.450)
PLN	9.350.000	USD	2.374.473	15-dic-2021	(24.169)
RUB	796.187.000	USD	10.815.412	06-oct-2021	118.597
RUB	683.077.000	USD	9.348.170	03-nov-2021	(16.173)
RUB	244.858.000	USD	3.301.863	15-dic-2021	15.145
SEK	128.180.000	USD	14.730.262	06-oct-2021	(88.245)
SEK	1.578.000	USD	180.028	04-nov-2021	265

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
SGD	9.677.000	USD	7.202.159	06-oct-2021	(75.221)
SGD	5.472.000	USD	4.020.130	03-nov-2021	9.681
SGD	6.960.000	USD	5.168.771	15-dic-2021	(43.655)
THB	257.743.424	USD	7.944.370	06-oct-2021	(326.862)
THB	52.580.000	USD	1.590.512	15-dic-2021	(37.147)
TRY	181.230.943	USD	20.836.628	06-oct-2021	(477.986)
TRY	61.616.000	USD	6.826.390	04-nov-2021	(12.154)
TRY	25.950.000	USD	2.895.887	15-dic-2021	(87.757)
TRY	4.846.000	USD	538.385	20-dic-2021	(15.462)
TWD	242.425.000	USD	8.783.112	06-oct-2021	(81.814)
TWD	34.850.000	USD	1.260.626	29-oct-2021	(9.796)
TWD	60.367.000	USD	2.173.234	04-nov-2021	(6.551)
TWD	72.975.000	USD	2.650.745	15-dic-2021	(31.398)
USD	13.505.682	AUD	18.573.000	06-oct-2021	78.219
USD	671.177	AUD	925.000	29-oct-2021	2.375
USD	1.276.813	AUD	1.770.000	04-nov-2021	(2.983)
USD	1.939.155	AUD	2.627.000	15-dic-2021	39.289
USD	11.430.608	BRL	60.838.000	04-oct-2021	258.961
USD	690.140	BRL	3.730.000	03-nov-2021	8.432
USD	295.678	BRL	1.598.000	12-nov-2021	4.108
USD	5.111.024	BRL	27.210.000	02-dic-2021	164.637
USD	116.929	BRL	640.000	10-mar-2022	2.996
USD	268.550	BRL	1.540.000	14-jul-2022	2.354
USD	240.882	CAD	300.000	05-oct-2021	4.028
USD	25.526.198	CAD	32.234.553	06-oct-2021	76.649
USD	319.216	CAD	400.000	07-oct-2021	3.413
USD	199.988	CAD	250.000	12-oct-2021	2.613
USD	403.923	CAD	505.000	14-oct-2021	5.225
USD	217.412	CAD	275.000	20-oct-2021	301
USD	927.426	CAD	1.175.000	29-oct-2021	(220)
USD	683.236	CAD	845.000	03-nov-2021	16.124
USD	27.675	CAD	35.000	17-nov-2021	44
USD	697.983	CAD	900.000	01-dic-2021	(12.522)
USD	750.689	CAD	960.000	02-dic-2021	(7.180)
USD	157.845	CAD	200.000	06-dic-2021	(47)
USD	6.293.143	CAD	7.955.000	15-dic-2021	12.655
USD	316.866	CAD	400.000	20-dic-2021	1.055
USD	165.160	CAD	200.000	18-ene-2022	7.250
USD	319.691	CAD	400.000	26-ene-2022	3.875
USD	79.875	CAD	100.000	28-ene-2022	922
USD	199.014	CAD	250.000	23-feb-2022	1.643
USD	239.239	CAD	300.000	24-feb-2022	2.395
USD	273.069	CAD	346.000	07-mar-2022	(84)
USD	161.336	CAD	200.000	12-abr-2022	3.465
USD	143.961	CAD	180.000	26-abr-2022	1.888
USD	206.871	CAD	250.000	11-may-2022	9.567
USD	1.727.107	CHF	1.587.788	06-oct-2021	23.288
USD	12.342.637	CLP	9.640.331.000	06-oct-2021	454.853
USD	496.956	CLP	382.789.000	29-oct-2021	26.052

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
USD	5.956.678	CLP	4.852.131.000	04-nov-2021	(8.641)
USD	4.125.687	CLP	3.273.530.000	15-dic-2021	115.482
USD	339.011	CLP	266.632.000	24-dic-2021	12.640
USD	75.902	CLP	58.900.000	30-dic-2021	3.844
USD	175.696	CLP	140.155.000	14-feb-2022	4.921
USD	353.914	CLP	282.972.000	14-mar-2022	9.962
USD	6.736.559	CNH	43.576.247	08-oct-2021	(19.426)
USD	303.964	CNH	1.974.000	29-oct-2021	(1.546)
USD	2.224.262	CNH	14.419.000	04-nov-2021	(6.212)
USD	2.967.365	CNH	19.285.000	15-dic-2021	(6.128)
USD	605.926	CNH	3.967.000	15-mar-2022	(1.399)
USD	17.832.465	CNY	115.360.000	08-oct-2021	(14.823)
USD	489.224	CNY	3.171.000	04-nov-2021	(346)
USD	65.065	CNY	422.000	15-dic-2021	114
USD	3.227.097	COP	12.163.174.000	06-oct-2021	33.265
USD	1.343.654	COP	5.165.274.000	04-nov-2021	(9.734)
USD	1.842.617	COP	7.112.000.000	15-dic-2021	(15.817)
USD	10.746.944	CZK	232.680.000	06-oct-2021	111.645
USD	2.807.173	CZK	60.760.000	15-dic-2021	36.400
USD	405.043	DKK	2.535.000	15-dic-2021	9.601
USD	17.180.401	EUR	14.554.000	06-oct-2021	321.074
USD	820.158	EUR	707.000	08-oct-2021	1.138
USD	1.334.340	EUR	1.143.000	14-oct-2021	10.079
USD	31.854.624	EUR	27.188.000	29-oct-2021	346.116
USD	7.631.613	EUR	6.570.000	04-nov-2021	16.677
USD	3.609.126	EUR	3.114.000	07-dic-2021	(2.724)
USD	12.317.777	EUR	10.391.000	15-dic-2021	262.554
USD	21.762.454	GBP	15.836.000	06-oct-2021	424.995
USD	7.136.510	GBP	5.237.000	29-oct-2021	79.948
USD	14.648.663	GBP	10.883.000	04-nov-2021	(15.666)
USD	1.058.333	GBP	781.000	13-dic-2021	5.900
USD	1.478.268	GBP	1.071.000	15-dic-2021	35.025
USD	944.652	HKD	7.350.000	06-oct-2021	480
USD	698.931	HKD	5.440.000	29-oct-2021	63
USD	422.468	HKD	3.290.000	04-nov-2021	(201)
USD	923.886	HKD	7.181.000	15-dic-2021	1.257
USD	9.811.929	HUF	2.925.228.000	06-oct-2021	384.584
USD	7.168.726	HUF	2.143.400.000	29-oct-2021	266.694
USD	711.510	HUF	221.028.000	04-nov-2021	(74)
USD	3.105.965	HUF	932.500.000	15-dic-2021	108.262
USD	6.920.668	HUF	2.143.400.000	29-jul-2022	107.649
USD	3.983.978	IDR	56.905.000.000	06-oct-2021	8.936
USD	2.305.976	IDR	33.184.000.000	15-dic-2021	4.328
USD	11.405.179	ILS	36.588.425	06-oct-2021	56.117
USD	4.132.618	ILS	13.291.000	04-nov-2021	9.193
USD	2.952.590	ILS	9.460.000	15-dic-2021	16.224
USD	17.284.895	INR	1.282.387.000	06-oct-2021	12.110
USD	584.889	INR	43.230.000	29-oct-2021	4.183
USD	5.269.340	INR	393.090.000	03-nov-2021	(7.833)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
USD	625.914	INR	46.374.000	09-dic-2021	5.518
USD	2.843.942	INR	211.550.000	15-dic-2021	15.564
USD	531.944	JPY	59.300.000	04-oct-2021	(874)
USD	12.106.353	JPY	1.334.072.799	06-oct-2021	119.363
USD	237.167	JPY	26.050.000	12-oct-2021	3.091
USD	1.762.068	JPY	193.400.000	18-oct-2021	24.173
USD	595.695	JPY	65.400.000	25-oct-2021	7.982
USD	2.343.560	JPY	259.500.000	29-oct-2021	11.516
USD	6.523.181	JPY	729.473.000	04-nov-2021	(32.630)
USD	500.979	JPY	55.000.000	08-nov-2021	6.676
USD	1.495.389	JPY	165.000.000	15-nov-2021	12.407
USD	144.544	JPY	15.850.000	22-nov-2021	2.081
USD	1.781.689	JPY	195.800.000	29-nov-2021	21.707
USD	2.187.076	JPY	240.450.000	06-dic-2021	25.554
USD	1.495.786	JPY	164.250.000	13-dic-2021	19.053
USD	158.267	JPY	17.401.000	15-dic-2021	1.812
USD	2.066.489	JPY	226.850.000	20-dic-2021	26.642
USD	1.760.917	JPY	194.200.000	06-ene-2022	14.139
USD	345.074	JPY	37.700.000	25-ene-2022	5.919
USD	144.315	JPY	15.800.000	10-feb-2022	2.156
USD	8.712.421	KRW	10.226.830.000	06-oct-2021	75.229
USD	9.099.760	KRW	10.788.510.000	04-nov-2021	(7.018)
USD	1.202.813	KRW	1.410.057.000	17-nov-2021	12.797
USD	2.168.300	KRW	2.536.510.000	15-dic-2021	28.292
USD	18.599.349	MXN	379.965.461	06-oct-2021	198.638
USD	5.341.817	MXN	110.230.000	04-nov-2021	26.757
USD	340.372	MXN	6.923.000	12-nov-2021	6.969
USD	3.959.578	MXN	80.462.000	15-dic-2021	103.014
USD	681.172	MXN	13.712.000	17-dic-2021	24.122
USD	346.612	MXN	7.239.000	10-ene-2022	858
USD	646.727	MXN	13.190.000	15-mar-2022	22.671
USD	15.246.698	NOK	131.913.000	06-oct-2021	156.946
USD	10.194.067	NOK	89.563.000	04-nov-2021	(48.928)
USD	12.699.119	NZD	17.980.000	06-oct-2021	286.758
USD	179.874	NZD	260.000	22-oct-2021	401
USD	819.961	NZD	1.156.000	15-dic-2021	22.379
USD	3.548.054	PEN	14.615.000	06-oct-2021	13.347
USD	509.007	PEN	2.105.000	04-nov-2021	270
USD	1.915.263	PEN	7.905.000	15-dic-2021	8.422
USD	2.326.728	PHP	117.670.000	06-oct-2021	20.067
USD	961.355	PHP	49.255.000	04-nov-2021	(3.146)
USD	2.348.923	PHP	119.640.000	15-dic-2021	9.669
USD	8.708.716	PLN	34.059.592	06-oct-2021	145.140
USD	2.876.081	PLN	11.470.000	04-nov-2021	(7.660)
USD	5.169.098	PLN	19.952.000	15-dic-2021	153.777
USD	10.920.997	RUB	796.187.000	06-oct-2021	(13.012)
USD	144.960	RUB	10.590.000	03-nov-2021	283
USD	4.362.043	RUB	322.523.000	15-dic-2021	(7.068)
USD	343.670	RUB	26.143.000	27-ene-2022	(7.422)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
USD	656.656	RUB	49.676.000	01-mar-2022	(6.790)	
USD	14.893.416	SEK	128.180.000	06-oct-2021	251.396	
USD	11.233.797	SEK	98.541.000	04-nov-2021	(24.891)	
USD	898.416	SEK	7.684.000	15-dic-2021	20.058	
USD	7.132.939	SGD	9.677.000	06-oct-2021	6.001	
USD	1.828.129	SGD	2.485.000	03-nov-2021	(1.929)	
USD	6.488.640	SGD	8.750.000	15-dic-2021	45.427	
USD	16.442.045	THB	537.754.847	06-oct-2021	548.905	
USD	2.761.444	THB	91.610.000	15-dic-2021	55.021	
USD	21.040.021	TRY	181.587.511	06-oct-2021	641.323	
USD	14.241.161	TRY	128.455.000	04-nov-2021	35.067	
USD	3.592.801	TRY	32.269.000	15-dic-2021	100.871	
USD	8.762.481	TWD	242.425.000	06-oct-2021	61.184	
USD	656.711	TWD	18.250.000	04-nov-2021	1.685	
USD	3.886.202	TWD	107.075.000	15-dic-2021	42.878	
USD	21.483.490	ZAR	314.589.000	06-oct-2021	598.815	
USD	613.889	ZAR	9.503.000	25-oct-2021	(15.329)	
USD	4.847.753	ZAR	73.729.000	04-nov-2021	(27.356)	
USD	775.240	ZAR	11.760.000	12-nov-2021	(1.444)	
USD	11.330.885	ZAR	165.804.000	15-dic-2021	432.189	
ZAR	314.589.000	USD	21.161.834	06-oct-2021	(277.160)	
ZAR	5.202.000	USD	350.067	25-oct-2021	(5.630)	
ZAR	10.934.000	USD	737.462	12-nov-2021	(15.331)	
ZAR	56.555.000	USD	3.849.709	15-dic-2021	(132.212)	
ZAR	17.108.000	USD	1.088.295	24-feb-2022	25.238	
					USD	1.743.020
Cobertura de las Clases de Participaciones						
BRL	113.327.895	USD	21.402.767	29-oct-2021	(675.487)	
CHF	4.242.693	USD	4.596.838	29-oct-2021	(41.492)	
EUR	86.554.319	USD	101.469.420	29-oct-2021	(1.160.548)	
GBP	45.004.631	USD	61.454.768	29-oct-2021	(813.559)	
SGD	2.671.869	USD	1.981.763	29-oct-2021	(14.068)	
USD	412.199	BRL	2.237.791	29-oct-2021	2.914	
USD	7.465	CHF	6.902	29-oct-2021	55	
USD	164.899	EUR	140.647	29-oct-2021	1.902	
USD	99.296	GBP	72.391	29-oct-2021	1.752	
USD	3.876	SGD	5.228	29-oct-2021	26	
					USD	(2.698.505)
					USD	(955.485)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Los contratos de divisas a plazo detallados a continuación estaban vinculados a las siguientes contrapartes:

Contrapartes de contratos de divisas a plazo

Subfondo	Contraparte	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	(2.554.405)
	UBS	287.576
		USD (2.266.829)
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	1.846.611
	HSBC	(20.074.790)
		USD (18.228.179)
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	(2.478.500)
	Morgan Stanley	(111.172)
		USD (2.589.672)
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(16.062.026)
	HSBC	3.443.836
		EUR (12.618.190)
Schroder GAIA Helix	Brown Brothers Harriman & Co	(3)
	Goldman Sachs	(1.345.366)
	HSBC	(5.111.211)
	J.P. Morgan	(1.364.088)
		USD (7.820.668)
Schroder GAIA Oaktree Credit*	HSBC	(42.374)
	State Street	181.536
		USD 139.162
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	(1.472.648)
	Morgan Stanley	890.875
		USD (581.773)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	721.467
	Deutsche Bank	(577.681)
	HSBC	(6.566.642)
	Morgan Stanley	212.622
	Newedge Group	524.827
		USD (5.685.407)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	HSBC	57.973
		GBP 57.973
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	(12.479)
	Barclays Bank	969.631
	BNP Paribas	(293.207)
	Citi Bank	208.692
	Credit Suisse	58.541
	Deutsche Bank	7.109
	Goldman Sachs	(137.400)
	HSBC	(2.654.593)
	J.P. Morgan	5.083
	Morgan Stanley	1.095.164
	Standard Chartered Bank	(202.026)
	USD (955.485)	

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Operaciones al contado

Las operaciones al contado se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo sobre la base del tipo de cambio al contado al vencimiento del contrato correspondiente. La plusvalía o la minusvalía latente se muestra en el Balance en el epígrafe "Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre operaciones al contado".

A 30 de septiembre de 2021, el siguiente subfondo formaba parte de las operaciones al contado:

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de liquidación	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Cobertura de cartera					
AUD	1.000.000	USD	723.730	01-oct-2021	(780)
CAD	1.716.820	GBP	1.000.000	01-oct-2021	8.056
CAD	1.000.000	JPY	87.685.000	01-oct-2021	1.654
CAD	2.543.050	USD	2.000.000	01-oct-2021	7.777
CZK	25.467.500	USD	1.158.667	01-oct-2021	5.487
EUR	1.000.000	CZK	25.467.500	01-oct-2021	(5.804)
EUR	1.000.000	GBP	862.330	01-oct-2021	(3.553)
EUR	1.000.000	GBP	860.550	04-oct-2021	(1.155)
EUR	3.000.000	USD	3.497.710	01-oct-2021	(22.660)
EUR	500.000	USD	579.582	04-oct-2021	(408)
GBP	1.862.330	USD	2.505.299	01-oct-2021	4.004
GBP	691.000	USD	930.632	04-oct-2021	421
JPY	87.685.000	USD	783.994	01-oct-2021	3.867
JPY	112.018.000	USD	1.000.000	04-oct-2021	6.496
SEK	10.203.700	EUR	1.000.000	01-oct-2021	7.201
SGD	1.357.490	USD	997.177	01-oct-2021	2.595
THB	2.023.600	USD	59.764	04-oct-2021	44
USD	720.530	AUD	1.000.000	01-oct-2021	(2.420)
USD	4.640.861	EUR	4.000.000	01-oct-2021	7.461
USD	1.159.891	SEK	10.203.700	01-oct-2021	(5.660)
USD	1.000.000	SGD	1.357.490	01-oct-2021	228
USD	938.751	THB	31.788.000	01-oct-2021	(749)
USD					12.102

Contrapartes de operaciones al contado

Fondo	Contraparte	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
	Brown Brothers Harriman & Co	(408)
	Citi Bank	7.677
	Deutsche Bank	(3.717)
	Morgan Stanley	421
	Newedge Group	8.129
USD		12.102

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de futuros

Los contratos de futuros se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. La plusvalía/(minusvalía) latente se muestra en el Balance bajo el apartado "Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de futuros". A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos mantenían contratos de futuros abiertos sobre índices (expuestos a renta variable), valores de renta fija y divisas:

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend							
Mar-22	30	Futuro sobre Euroswiss ICE a 3 meses	Morgan Stanley	CHF	8.107.999	100,72	(2.414)
Dic-21	101	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	73.008.215	10,00	4.328
Mar-22	81	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	58.547.042	10,00	1.798
Jun-22	78	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	56.361.323	10,00	12.094
Sep-22	2	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	1.445.223	9,99	(107)
Jun-22	75	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	18.708.338	99,80	3.225
Sep-22	63	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	15.701.856	99,69	(1.469)
Dic-22	49	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	12.194.350	99,51	(4.988)
Mar-24	48	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(11.852.050)	98,73	5.050
Jun-24	41	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(10.111.375)	98,61	4.362
Sep-24	44	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(10.841.300)	98,50	6.850
Dic-24	38	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(9.352.850)	98,40	5.325
Mar-25	39	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(9.594.613)	98,32	8.412
Jun-25	37	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(9.097.600)	98,26	9.013
Sep-25	45	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(11.060.725)	98,20	13.788
Jun-22	1	Futuro sobre libra esterlina a 90 días	Morgan Stanley	GBP	(167.625)	99,37	261
Sep-22	1	Futuro sobre libra esterlina a 90 días	Morgan Stanley	GBP	(167.473)	99,26	303
Dic-22	1	Futuro sobre libra esterlina a 90 días	Morgan Stanley	GBP	(167.364)	99,19	312
Mar-24	956	Futuro sobre libra esterlina a 90 días	Morgan Stanley	GBP	(159.755.033)	98,99	375.032
Oct-21	7	Futuro sobre índice Amsterdam	Credit Suisse	EUR	(1.294.109)	770,33	44.872
Dic-21	221	Futuro sobre bono australiano a 10 años	Morgan Stanley	AUD	22.937.908	141,47	(334.560)
Dic-21	1.743	Futuro sobre bono australiano a 3 años	Morgan Stanley	AUD	146.913.907	116,44	(190.063)
Mar-22	256	Futuro sobre aceptación bancaria	Credit Suisse	CAD	50.245.431	99,41	(17.103)
Jun-22	49	Futuro sobre aceptación bancaria	Credit Suisse	CAD	(9.596.785)	99,21	2.112
Sep-22	35	Futuro sobre aceptación bancaria	Credit Suisse	CAD	(6.840.508)	98,99	2.369
Dic-22	33	Futuro sobre aceptación bancaria	Credit Suisse	CAD	(6.443.214)	98,77	9.829
Oct-21	1.018	Futuro sobre índice BIST 30	Morgan Stanley	TRY	(1.728.511)	1.517,75	(8.889)
Oct-21	64	Futuro sobre índice CAC 40	Credit Suisse	EUR	4.913.283	6.518,00	(81.203)
Dic-21	102	Futuro sobre bono canadiense a 10 años	Credit Suisse	CAD	(11.584.052)	143,15	56.103
Oct-21	4	Futuro sobre CBOE VIX	Credit Suisse	USD	(89.950)	22,87	(1.521)
Nov-21	8	Futuro sobre CBOE VIX	Credit Suisse	USD	(186.850)	23,69	(2.637)
Dic-21	2	Futuro sobre índice Dax	Morgan Stanley	EUR	889.309	15.288,00	(3.866)
Dic-21	4	Futuro sobre Dow Jones E-mini e-CBOT	Credit Suisse	USD	691.475	33.722,00	(17.035)
Dic-21	4	Futuro sobre E-mini S&P 500	Morgan Stanley	USD	880.200	4.297,75	(20.650)
Jun-22	57	Futuro sobre Euro Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	(16.589.802)	100,49	3.258
Sep-22	48	Futuro sobre Euro Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	(13.966.095)	100,45	3.345
Dic-22	42	Futuro sobre Euro Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	(12.221.519)	100,42	7.761
Mar-24	143	Futuro sobre Euro Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	(41.502.116)	100,22	2.071
Dic-21	3	Futuro sobre Euro BUXL a 30 años	Morgan Stanley	EUR	(709.443)	203,34	2.826
Dic-21	60	Futuro sobre Euro Stoxx 50	Morgan Stanley	EUR	2.887.952	4.048,00	(74.551)
Dic-21	11	Futuro sobre Euro-BOBL	Morgan Stanley	EUR	(1.719.455)	134,93	197
Dic-21	72	Futuro sobre Euro-BTP	Morgan Stanley	EUR	12.875.755	151,95	(202.943)
Dic-21	37	Futuro sobre Euro-Bund	Morgan Stanley	EUR	7.373.164	169,82	(94.857)
Dic-21	49	Futuro sobre Euro-OAT	Morgan Stanley	EUR	(9.429.791)	165,95	10.610
Dic-21	62	Futuro sobre índice FTSE 100	Morgan Stanley	GBP	5.858.374	7.073,50	50.743
Oct-21	141	Futuro sobre FTSE China A50	Morgan Stanley	USD	(2.179.589)	15.493,00	(4.924)
Dic-21	25	Futuro sobre índice FTSE MIB	Morgan Stanley	EUR	3.704.490	25.373,00	(30.638)
Dic-21	34	Futuro sobre FTSE/JSE Top 40	Morgan Stanley	ZAR	(1.290.191)	58.181,00	(23.434)
Oct-21	2	Futuro sobre índice Hang Seng	Morgan Stanley	HKD	(314.215)	24.524,00	(816)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de futuros (continuación)

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)							
Oct-21	60	Futuro sobre índice HSCEI	Morgan Stanley	HKD	(3.349.502)	8.721,00	(11.343)
Oct-21	3	Futuro sobre índice IBEX 35	Morgan Stanley	EUR	(304.217)	8.816,40	(2.157)
Dic-21	12	Futuro sobre bono a 10 años de Japón (OSE)	Morgan Stanley	JPY	16.367.582	151,37	(46.633)
Dic-21	48	Futuro sobre índice KOSPI2	Credit Suisse	KRW	(4.143.644)	401,50	74.388
Dic-21	108	Futuro sobre Gilt largo	Morgan Stanley	GBP	(18.456.577)	125,15	244.850
Oct-21	341	Futuro sobre Mini Bovespa	Morgan Stanley	BRL	(1.407.436)	110.773,00	20.168
Dic-21	28	Futuro sobre índice MSCI EAFE	Credit Suisse	USD	3.327.100	2.267,00	(153.300)
Dic-21	6	Futuro sobre índice MSCI Emerging Market	Credit Suisse	USD	(373.670)	1.245,60	(10)
Oct-21	50	Futuro sobre ETS sobre índice MSCI Singapore	Morgan Stanley	SGD	1.321.244	353,50	(19.506)
Dic-21	3	Futuro sobre Nasdaq 100 E-mini	Morgan Stanley	USD	907.476	14.682,50	(26.526)
Dic-21	10	Futuro sobre Nikkei 225 (OSE)	Morgan Stanley	JPY	2.684.751	29.460,00	(37.732)
Dic-21	7	Futuro sobre Nikkei 225 (SGX)	Morgan Stanley	JPY	926.052	29.670,00	7.008
Oct-21	33	Futuro sobre índice OMXS30	Morgan Stanley	SEK	(878.530)	2.253,25	29.160
Dic-21	6	Futuro sobre Russell 2000 E-mini	Credit Suisse	USD	672.905	2.200,80	(12.665)
Dic-21	3	Futuro sobre S&P MidCap 400 E-mini	Morgan Stanley	USD	808.360	2.633,20	(18.400)
Dic-21	48	Futuro sobre índice S&P/TSX 60	Credit Suisse	CAD	9.267.031	1.196,10	(201.375)
Dic-21	546	Futuro sobre índice SET 50	Credit Suisse	THB	3.150.154	962,20	(44.724)
Oct-21	108	Futuro sobre SGX Nifty 50	Morgan Stanley	USD	3.832.345	17.602,00	(30.313)
Dic-21	562	Futuro sobre Short-Term Euro-BTP	Morgan Stanley	EUR	74.121.668	113,71	(97.290)
Dic-21	222	Futuro sobre bono a 10 años de Corea del Sur	Credit Suisse	KRW	(23.515.608)	124,21	226.233
Dic-21	592	Futuro sobre bono a 3 años de Corea del Sur	Credit Suisse	KRW	(54.756.292)	109,40	56.292
Dic-21	100	Futuro sobre SPI 200	Morgan Stanley	AUD	13.346.054	7.293,00	(164.869)
Dic-21	22	Futuro sobre índice Swiss Market	Morgan Stanley	CHF	2.802.286	11.601,00	(63.705)
Dic-21	32	Futuro sobre índice Topix	Morgan Stanley	JPY	5.897.893	2.030,50	(59.715)
Dic-21	54	Futuro sobre índice WIG20	Morgan Stanley	PLN	634.665	2.303,00	(9.298)
						USD	(813.881)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Dic-21	520	Futuro sobre E-mini S&P 500	Goldman Sachs	USD	(99.856.343)	4.297,75	3.390.249
						EUR	3.390.249
Schroder GAIA Helix							
Dic-21	15	Futuro sobre E-mini S&P 500	Goldman Sachs	USD	(3.344.438)	4.297,75	121.125
Dic-21	211	Futuro sobre Euro Stoxx 50	Goldman Sachs	EUR	(10.074.083)	4.048,00	180.291
Dic-21	310	Futuro sobre Euro Stoxx	J.P. Morgan	EUR	(8.336.871)	453,10	201.721
Dic-21	237	Futuro sobre índice FTSE 100	J.P. Morgan	GBP	(22.372.741)	7.073,50	(215.335)
Dic-21	400	Futuro sobre índice FTSE 250	Goldman Sachs	GBP	(25.437.677)	23.049,00	592.699
Dic-21	53	Futuro sobre MSCI AC AXJ NTR	J.P. Morgan	USD	(3.366.719)	613,25	116.494
Dic-21	105	Futuro sobre MSCI Asia	J.P. Morgan	USD	(6.831.534)	632,30	192.384
Dic-21	119	Futuro sobre MSCI China	J.P. Morgan	USD	(6.015.009)	992,60	109.039
Dic-21	15	Futuro sobre índice MSCI EAFE	J.P. Morgan	USD	(1.763.465)	2.267,00	63.215
Dic-21	374	Futuro sobre índice MSCI Emerging Market	J.P. Morgan	USD	(24.060.490)	1.245,60	767.770
Dic-21	79	Futuro sobre MSCI Europe	J.P. Morgan	EUR	(2.806.930)	298,70	73.537
Dic-21	203	Futuro sobre MSCI Europe	J.P. Morgan	EUR	(6.573.888)	274,30	123.860
Dic-21	341	Futuro sobre MSCI Poland	Goldman Sachs	USD	(7.213.097)	205,10	219.187
Dic-21	59	Futuro sobre MSCI Russia	Goldman Sachs	USD	(2.937.195)	1.023,80	(83.015)
Dic-21	208	Futuro sobre MSCI Saudi Arabia	Goldman Sachs	USD	(3.467.405)	1.692,00	(51.955)
Dic-21	183	Futuro sobre índice MSCI World	J.P. Morgan	USD	(17.217.920)	9.133,00	504.530
Dic-21	141	Futuro sobre índice Topix	J.P. Morgan	JPY	(25.987.738)	2.030,50	263.267
						USD	3.178.814

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de futuros (continuación)

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Dic-22	650	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(161.776.875)	99,51	81.250
Jun-23	8	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(1.986.000)	99,22	1.700
Dic-23	11	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	2.721.863	98,86	(3.350)
Jun-24	26	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	6.419.060	98,61	(9.735)
Sep-24	40	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	9.866.388	98,50	(16.888)
Dic-24	20	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	4.931.638	98,40	(11.888)
Oct-21	36	Futuro sobre índice Amsterdam	Newedge Group	EUR	6.648.924	770,33	(224.280)
Dic-21	211	Futuro sobre bono australiano a 10 años	Newedge Group	AUD	21.978.976	141,47	(398.404)
Dic-21	6	Futuro sobre dólar australiano	Morgan Stanley	USD	(441.241)	72,34	7.201
Sep-22	25	Futuro sobre aceptación bancaria	Newedge Group	CAD	(4.893.021)	98,99	8.635
Dic-21	5	Futuro sobre libra esterlina	Morgan Stanley	USD	(428.231)	134,75	7.138
Oct-21	93	Futuro sobre índice CAC 40	Newedge Group	EUR	7.122.035	6.518,00	(100.419)
Dic-21	202	Futuro sobre bono canadiense a 10 años	Newedge Group	CAD	23.307.445	143,15	(477.586)
Dic-21	5	Futuro sobre dólar canadiense	Morgan Stanley	USD	394.275	78,99	675
Oct-21	220	Futuro sobre CBOE VIX	Morgan Stanley	USD	(4.585.622)	22,87	(445.294)
Nov-21	60	Futuro sobre CBOE VIX	Morgan Stanley	USD	(1.311.978)	23,69	(109.176)
Dic-21	100	Futuro sobre índice Dax	Newedge Group	EUR	45.471.246	15.288,00	(1.199.109)
Dic-21	129	Futuro sobre Dow Jones E-mini e-CBOT	Morgan Stanley	USD	22.389.830	33.722,00	(639.140)
Oct-21	15	Futuro sobre Dubai IRD FX	Newedge Group	USD	405.340	134,29	(2.470)
Dic-21	117	Futuro sobre E-mini S&P 500	Morgan Stanley	USD	26.096.268	4.297,75	(954.430)
Dic-21	30	Futuro sobre bono Euro BUXL a 30 años	Newedge Group	EUR	7.318.664	203,34	(252.497)
Dic-21	3	Futuro sobre Euro FX	Morgan Stanley	USD	(442.786)	1,16	7.786
Dic-21	748	Futuro sobre Euro Stoxx 50	Newedge Group	EUR	35.979.173	4.048,00	(905.447)
Dic-21	65	Futuro sobre Euro Stoxx Bank	Credit Suisse	EUR	(353.876)	98,30	(16.188)
Dic-21	31	Futuro sobre Euro-BOBL	Morgan Stanley	EUR	4.877.673	134,93	(32.492)
Dic-21	225	Futuro sobre Euro-BTP	Newedge Group	EUR	(40.129.750)	151,95	527.212
Dic-21	684	Futuro sobre Euro-Bund	Morgan Stanley	EUR	136.733.436	169,82	(2.183.116)
Dic-21	193	Futuro sobre Euro-OAT	Credit Suisse	EUR	37.736.946	165,95	(636.907)
Dic-21	11	Futuro sobre Euro-Schatz	Morgan Stanley	EUR	(1.430.817)	112,21	1.118
Dic-21	249	Futuro sobre índice FTSE 100	Newedge Group	GBP	(23.583.481)	7.073,50	(148.295)
Oct-21	116	Futuro sobre FTSE China A50	Newedge Group	USD	1.798.663	15.493,00	(1.475)
Dic-21	35	Futuro sobre índice FTSE MIB	Newedge Group	EUR	(5.193.815)	25.373,00	50.423
Dic-21	40	Futuro sobre FTSE/JSE Top 40	Newedge Group	ZAR	(1.548.727)	58.181,00	3.287
Oct-21	63	Futuro sobre índice IBEX 35	Newedge Group	EUR	(6.377.450)	8.816,40	(56.410)
Dic-21	13	Futuro sobre bono a 10 años de Japón (OSE)	Credit Suisse	JPY	17.735.568	151,37	(54.540)
Dic-21	4	Futuro sobre yen japonés	Morgan Stanley	USD	(451.438)	89,81	2.387
Dic-21	251	Futuro sobre índice KOSDAQ150	Newedge Group	KRW	3.148.469	1.454,90	(64.179)
Dic-21	292	Futuro sobre índice KOSPI2	Newedge Group	KRW	(25.522.779)	401,50	768.133
Dic-21	452	Futuro sobre Gilt largo	Newedge Group	GBP	78.589.946	125,15	(2.370.494)
Dic-21	17	Futuro sobre peso mexicano	Morgan Stanley	USD	421.770	4,80	(13.855)
Dic-21	44	Futuro sobre índice MSCI EAFE	Morgan Stanley	USD	(5.140.685)	2.267,00	153.285
Dic-21	194	Futuro sobre índice MSCI Emerging Market	Morgan Stanley	USD	(12.579.680)	1.245,60	497.360
Oct-21	258	Futuro sobre ETS sobre índice MSCI Singapore	Newedge Group	SGD	(6.810.952)	353,50	93.984
Dic-21	115	Futuro sobre Nasdaq 100 E-mini	Morgan Stanley	USD	35.425.098	14.682,50	(1.655.348)
Dic-21	6	Futuro sobre dólar neozelandés	Morgan Stanley	USD	426.690	69,05	(12.420)
Dic-21	18	Futuro sobre Nikkei 225 (OSE)	Credit Suisse	JPY	4.791.680	29.460,00	(27.045)
Dic-21	17	Futuro sobre Nikkei 225 (YEN)	Morgan Stanley	JPY	(2.258.929)	29.305,00	20.801
Oct-21	167	Futuro sobre índice OMXS30	Newedge Group	SEK	4.438.397	2.253,25	(140.070)
Dic-21	1.392	Futuro sobre índice RTS	Credit Suisse	USD	4.844.160	176.030,00	56.515
Dic-21	116	Futuro sobre Russell 2000 E-mini	Morgan Stanley	USD	(12.843.045)	2.200,80	78.405
Dic-21	30	Futuro sobre rublo ruso	Credit Suisse	RUB	(30.585)	73.681,00	218
Dic-21	22	Futuro sobre S&P MidCap 400 E-mini	Morgan Stanley	USD	5.952.540	2.633,20	(159.500)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de futuros (continuación)

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)							
Dic-21	57	Futuro sobre índice S&P/TSX 60	Newedge Group	CAD	11.051.934	1.196,10	(286.467)
Dic-21	603	Futuro sobre índice SET 50	Credit Suisse	THB	(3.491.923)	962,20	62.299
Oct-21	32	Futuro sobre SGX Nifty 50	Newedge Group	USD	(1.131.509)	17.602,00	4.981
Dic-21	265	Futuro sobre Short-Term Euro-BTP	Credit Suisse	EUR	34.947.639	113,71	(42.905)
Dic-21	74	Futuro sobre bono a 10 años de Corea del Sur	Newedge Group	KRW	7.906.250	124,21	(143.125)
Dic-21	20	Futuro sobre bono a 3 años de Corea del Sur	Newedge Group	KRW	1.854.561	109,40	(6.588)
Dic-21	14	Futuro sobre SPI 200	Newedge Group	AUD	1.849.631	7.293,00	(4.265)
Dic-21	10	Futuro Stoxx 600 Bank	Credit Suisse	EUR	(77.233)	138,90	(3.214)
Dic-21	95	Futuro sobre Stoxx Europe 600	Credit Suisse	EUR	2.555.727	453,80	(58.845)
Dic-21	3	Futuro sobre franco suizo	Morgan Stanley	USD	410.069	107,42	(7.244)
Dic-21	102	Futuro sobre índice Topix	Credit Suisse	JPY	(18.816.299)	2.030,50	207.107
Dic-21	3	Futuro sobre índice US Dollar	Morgan Stanley	USD	(277.512)	94,24	(5.208)
Dic-21	736	Futuro sobre pagaré a 10 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	98.128.930	131,61	(1.264.430)
Dic-21	600	Futuro sobre pagaré a 2 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(132.178.125)	110,03	145.312
Dic-21	154	Futuro sobre pagaré a 5 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	19.010.086	122,74	(107.789)
Oct-21	19	Futuro sobre índice US Dollar	Newedge Group	KRW	(188.235)	1.185,10	(1.942)
Dic-21	44	Futuro sobre bono largo de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(7.146.782)	159,22	141.157
Dic-21	10	Futuro sobre bono ultra de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.940.156)	191,06	29.531
Oct-21	55	Futuro VSTOXX Mini	Credit Suisse	EUR	(133.257)	23,20	(14.549)
Dic-21	50	Futuro sobre índice WIG20	Credit Suisse	PLN	(594.682)	2.303,00	15.639
						USD	(12.295.479)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
Dic-21	36	Futuro sobre índice FTSE 100	Morgan Stanley	GBP	(2.521.260)	7.073,50	(25.200)
						GBP	(25.200)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Sep-22	-	Futuro sobre eurodólar a 90 días	Morgan Stanley	USD	(100)	99,69	100
Dic-21	177	Futuro sobre bono australiano a 10 años	Morgan Stanley	AUD	(18.153.414)	141,47	50.280
Dic-21	24	Futuro sobre bono australiano a 3 años	Morgan Stanley	AUD	2.025.338	116,44	(5.044)
Dic-21	27	Futuro sobre bono canadiense a 10 años	Morgan Stanley	CAD	3.068.601	143,15	(17.085)
Dic-21	20	Futuro sobre bono canadiense a 5 años	Morgan Stanley	CAD	(1.988.197)	124,58	21.041
Oct-21	28	Futuro sobre CBOE VIX	Morgan Stanley	USD	(603.850)	22,87	(36.448)
Dic-21	6	Futuro sobre E-mini S&P 500	Morgan Stanley	USD	1.293.450	4.297,75	(4.125)
Dic-21	12	Futuro sobre bono Euro BUXL a 30 años	Morgan Stanley	EUR	2.740.309	203,34	86.158
Dic-21	28	Futuro sobre Euro Stoxx 50	Morgan Stanley	EUR	(1.350.138)	4.048,00	37.218
Dic-21	251	Futuro sobre Euro-BOBL	Morgan Stanley	EUR	(39.276.798)	134,93	46.461
Dic-21	-	Futuro sobre Euro-BTP	Morgan Stanley	EUR	(25.959)	151,95	25.959
Dic-21	156	Futuro sobre Euro-Bund	Morgan Stanley	EUR	(30.934.153)	169,82	247.238
Dic-21	80	Futuro sobre Euro-OAT	Morgan Stanley	EUR	(15.595.341)	165,95	217.086
Dic-21	70	Futuro sobre Euro-Schatz	Morgan Stanley	EUR	(9.098.526)	112,21	440
Dic-21	15	Futuro sobre índice KOSPI2	Morgan Stanley	KRW	(1.312.016)	401,50	40.373
Dic-21	79	Futuro sobre Gilt largo	Morgan Stanley	GBP	13.398.438	125,15	(76.896)
Dic-21	14	Futuro sobre índice MSCI EAFE	Morgan Stanley	USD	(1.658.525)	2.267,00	71.625
Dic-21	27	Futuro sobre índice MSCI Emerging Market	Morgan Stanley	USD	(1.695.550)	1.245,60	13.990
Dic-21	20	Futuro sobre Nasdaq 100 E-mini	Morgan Stanley	USD	(613.230)	14.682,50	25.929
Dic-21	2	Futuro sobre Nasdaq 100 E-mini	Morgan Stanley	USD	(590.910)	14.682,50	3.610
Dic-21	1	Futuro sobre Russell 2000 E-mini	Morgan Stanley	USD	111.805	2.200,80	(1.765)
Dic-21	32	Futuro sobre S&P500 Micro E-mini	Morgan Stanley	USD	(717.270)	4.297,75	29.630
Dic-21	746	Futuro sobre pagaré a 10 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(98.291.750)	131,61	111.156
Dic-21	2	Futuro sobre bono ultra a 10 años de EE. UU.	Morgan Stanley	USD	(299.781)	145,25	9.281
Dic-21	283	Futuro sobre pagaré a 2 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	62.301.821	110,03	(26.344)
Dic-21	516	Futuro sobre pagaré a 5 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(63.434.296)	122,74	99.327
Dic-21	9	Futuro sobre bono largo de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.469.594)	159,22	36.625
Dic-21	37	Futuro sobre bono ultra de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	7.260.375	191,06	(191.063)
						USD	814.757

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones

Los contratos de opciones se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo, y el valor de mercado, si es distinto de 0, se muestra en el Balance en el epígrafe "Opciones y swaptions a valor de mercado".

A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos estaban comprometidos con contratos de opciones existentes sobre índices financieros y participaciones internacionales cotizadas:

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend						
(1.318.324)	Venta sobre UBS ETC vinculada a una cesta de Systematica Strategy Delta-1 sobre un contrato de futuros sobre materias primas Precio de ejercicio 90,77 Con vencimiento el 1-oct-2021	UBS	USD	(6.443)	-	6.443
				USD	-	6.443
Schroder GAIA Helix						
223	Venta sobre el índice Deutsche Boerse AG German Stock DAX Precio de ejercicio 15.000,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Goldman Sachs	EUR	189.203	197.609	8.406
53	Venta sobre el índice FTSE 100 Precio de ejercicio 6.700,00 Con vencimiento el 17-dic-2021	Goldman Sachs	GBP	95.674	82.302	(13.372)
14	Venta sobre el índice MSCI Emerging Markets Precio de ejercicio 1.230,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Goldman Sachs	USD	19.792	23.590	3.798
5	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.275,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Goldman Sachs	USD	18.369	28.525	10.156
73	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.325,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Goldman Sachs	USD	294.426	544.580	250.154
				USD	876.606	259.142
Schroder GAIA Sirios US Equity						
50	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.100,00 Con vencimiento el 17-jun-2022	Goldman Sachs	USD	916.400	1.189.750	273.350
35	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.100,00 Con vencimiento el 16-sep-2022	Goldman Sachs	USD	872.499	1.020.775	148.276
				USD	2.210.525	421.626
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
37	Venta sobre el índice FTSE 100 Precio de ejercicio 6.700,00 Con vencimiento el 17-dic-2021	Morgan Stanley	GBP	48.531	42.642	(5.889)
				GBP	42.642	(5.889)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
90.526	Compra sobre Commerzbank AG Precio de ejercicio 6,30 Con vencimiento el 17-dic-2021	Goldman Sachs	EUR	19.127	17.190	(1.937)
272.000	Compra sobre Commerzbank AG Precio de ejercicio 6,40 Con vencimiento el 18-mar-2022	Goldman Sachs	EUR	82.970	92.076	9.106
19.487.029	Compra sobre el índice Euro Stoxx 50 frente al índice S&P 500 Precio de ejercicio 2,50 Con vencimiento el 16-dic-2022	Goldman Sachs	USD	216.902	100.962	(115.940)
17.905.507	Compra sobre el índice Euro Stoxx 50 frente al índice S&P 500 Precio de ejercicio 2,50 Con vencimiento el 17-dic-2021	Goldman Sachs	USD	176.846	34.325	(142.521)
6.750	Compra sobre Financial Select Sector SPDR Fund Precio de ejercicio 481,00 Con vencimiento el 17-jun-2022	Morgan Stanley	USD	139.616	166.222	26.606
5.136	Compra sobre Financial Select Sector SPDR Fund Precio de ejercicio 494,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Goldman Sachs	USD	29.532	15.123	(14.409)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
3.850	Compra sobre Financial Select Sector SPDR Fund Precio de ejercicio 506,00 Con vencimiento el 17-dic-2021	Morgan Stanley	USD	23.485	11.279	(12.206)
(1.155.000)	Compra sobre divisas AUD/JPY Precio de ejercicio 81,12 Con vencimiento el 12-oct-2021	Citi Bank	AUD	(8.554)	(2.882)	5.672
(1.155.000)	Compra sobre divisas AUD/JPY Precio de ejercicio 81,58 Con vencimiento el 5-oct-2021	BNP Paribas	AUD	(8.736)	(348)	8.388
961.000	Compra sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,60 Con vencimiento el 13-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.830	5.878	(2.952)
959.000	Compra sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,61 Con vencimiento el 27-oct-2021	Bank of America	EUR	8.788	7.040	(1.748)
(713.000)	Compra sobre divisas EUR/BRL Precio de ejercicio 6,29 Con vencimiento el 26-oct-2021	Bank of America	EUR	(14.826)	(16.257)	(1.431)
(720.000)	Compra sobre divisas EUR/BRL Precio de ejercicio 6,29 Con vencimiento el 8-oct-2021	Morgan Stanley	EUR	(15.796)	(9.659)	6.137
721.000	Compra sobre divisas EUR/CNH Precio de ejercicio 7,64 Con vencimiento el 12-oct-2021	Citi Bank	EUR	4.335	37	(4.298)
721.000	Compra sobre divisas EUR/CNH Precio de ejercicio 7,67 Con vencimiento el 5-oct-2021	Deutsche Bank	EUR	4.606	-	(4.606)
1.078.000	Compra sobre divisas EUR/JPY Precio de ejercicio 128,50 Con vencimiento el 20-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.535	9.236	701
713.000	Compra sobre divisas EUR/MXN Precio de ejercicio 23,65 Con vencimiento el 26-oct-2021	Bank of America	EUR	8.123	15.445	7.322
720.000	Compra sobre divisas EUR/MXN Precio de ejercicio 23,68 Con vencimiento el 8-oct-2021	Morgan Stanley	EUR	7.853	10.555	2.702
840.000	Compra sobre divisas EUR/NZD Precio de ejercicio 1,66 Con vencimiento el 13-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.655	13.487	4.832
838.000	Compra sobre divisas EUR/NZD Precio de ejercicio 1,67 Con vencimiento el 20-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.966	10.055	1.089
730.000	Compra sobre divisas EUR/SEK Precio de ejercicio 10,20 Con vencimiento el 28-oct-2021	Bank of America	EUR	4.460	2.426	(2.034)
3.272.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,16 Con vencimiento el 6-ene-2022	Goldman Sachs	EUR	41.535	41.414	(121)
1.198.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,17 Con vencimiento el 20-oct-2021	Barclays Bank	EUR	8.639	1.496	(7.143)
1.074.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,18 Con vencimiento el 16-nov-2021	Bank of America	EUR	13.705	1.878	(11.827)
1.028.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,19 Con vencimiento el 31-ene-2022	BNP Paribas	EUR	19.267	3.684	(15.583)
1.089.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,19 Con vencimiento el 4-oct-2021	Barclays Bank	EUR	14.935	-	(14.935)
1.202.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,19 Con vencimiento el 6-oct-2021	Barclays Bank	EUR	8.398	-	(8.398)
1.030.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,21 Con vencimiento el 14-feb-2022	Morgan Stanley	EUR	7.121	1.877	(5.244)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
3.004.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,22 Con vencimiento el 3-dic-2021	Goldman Sachs	EUR	51.134	471	(50.663)
(730.000)	Compra sobre divisas EUR/ZAR Precio de ejercicio 17,70 Con vencimiento el 28-oct-2021	Morgan Stanley	EUR	(14.118)	(9.912)	4.206
821.000	Compra sobre divisas GBP/AUD Precio de ejercicio 1,88 Con vencimiento el 27-oct-2021	Bank of America	GBP	8.365	4.117	(4.248)
811.000	Compra sobre divisas GBP/AUD Precio de ejercicio 1,88 Con vencimiento el 30-sep-2021	Barclays Bank	GBP	8.226	-	(8.226)
720.000	Compra sobre divisas GBP/JPY Precio de ejercicio 152,08 Con vencimiento el 6-oct-2021	Deutsche Bank	GBP	8.140	565	(7.575)
923.000	Compra sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,38 Con vencimiento el 13-oct-2021	Deutsche Bank	GBP	8.955	214	(8.741)
659.000	Compra sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,38 Con vencimiento el 18-oct-2021	Barclays Bank	GBP	12.379	234	(12.145)
670.000	Compra sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,38 Con vencimiento el 3-dic-2021	Bank of America	GBP	11.803	2.585	(9.218)
620.000	Compra sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,38 Con vencimiento el 5-oct-2021	Morgan Stanley	GBP	6.278	2	(6.276)
926.000	Compra sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,39 Con vencimiento el 6-oct-2021	BNP Paribas	GBP	8.789	4	(8.785)
775.000	Compra sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,70 Con vencimiento el 15-nov-2021	Morgan Stanley	NZD	9.652	3.059	(6.593)
1.205.000	Compra sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,70 Con vencimiento el 27-oct-2021	Morgan Stanley	NZD	9.128	3.566	(5.562)
1.195.000	Compra sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,71 Con vencimiento el 30-sep-2021	J.P. Morgan	NZD	8.724	-	(8.724)
(1.205.000)	Compra sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,71 Con vencimiento el 8-oct-2021	Morgan Stanley	NZD	(9.769)	(241)	9.528
1.856.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,98 Con vencimiento el 8-mar-2022	Deutsche Bank	USD	38.740	43.368	4.628
2.465.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 6,00 Con vencimiento el 10-mar-2022	Goldman Sachs	USD	50.614	57.288	6.674
2.444.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 6,34 Con vencimiento el 12-jul-2022	Deutsche Bank	USD	74.618	75.432	814
1.104.000	Compra sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,91 Con vencimiento el 11-oct-2021	Morgan Stanley	USD	13.855	21.753	7.898
1.081.000	Compra sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,91 Con vencimiento el 26-nov-2021	BNP Paribas	USD	13.511	25.383	11.872
855.000	Compra sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 767,00 Con vencimiento el 6-oct-2021	Bank of America	USD	13.285	46.483	33.198
(2.428.000)	Compra sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 786,70 Con vencimiento el 2-dic-2021	Deutsche Bank	USD	(74.345)	(111.201)	(36.856)
852.000	Compra sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 791,25 Con vencimiento el 12-oct-2021	Bank of America	USD	13.434	22.811	9.377

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
(1.852.000)	Compra sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 865,00 Con vencimiento el 10-mar-2022	Goldman Sachs	USD	(32.110)	(41.629)	(9.519)
1.220.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,46 Con vencimiento el 2-dic-2021	Goldman Sachs	USD	17.693	9.656	(8.037)
(843.000)	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,50 Con vencimiento el 20-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(4.268)	(1.163)	3.105
1.587.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,50 Con vencimiento el 9-dic-2021	Barclays Bank	USD	13.521	9.208	(4.313)
1.579.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,52 Con vencimiento el 21-oct-2021	Barclays Bank	USD	13.958	1.389	(12.569)
1.212.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,56 Con vencimiento el 27-oct-2021	Morgan Stanley	USD	11.284	752	(10.532)
(1.220.000)	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,63 Con vencimiento el 2-dic-2021	Goldman Sachs	USD	(7.288)	(1.596)	5.692
(1.212.000)	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,68 Con vencimiento el 27-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(4.768)	(140)	4.628
670.000	Compra sobre divisas USD/CZK Precio de ejercicio 21,63 Con vencimiento el 30-nov-2021	Morgan Stanley	USD	10.074	13.173	3.099
679.000	Compra sobre divisas USD/CZK Precio de ejercicio 21,81 Con vencimiento el 11-oct-2021	J.P. Morgan	USD	11.000	4.863	(6.137)
2.390.000	Compra sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 302,79 Con vencimiento el 20-oct-2021	Barclays Bank	USD	24.617	61.416	36.799
2.376.000	Compra sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 303,97 Con vencimiento el 25-oct-2021	Barclays Bank	USD	24.116	54.879	30.763
671.000	Compra sobre divisas USD/IDR Precio de ejercicio 14.370,00 Con vencimiento el 21-dic-2021	Bank of America	USD	9.991	10.386	395
667.000	Compra sobre divisas USD/IDR Precio de ejercicio 14.510,00 Con vencimiento el 8-nov-2021	Barclays Bank	USD	10.659	3.256	(7.403)
997.000	Compra sobre divisas USD/IDR Precio de ejercicio 14.773,00 Con vencimiento el 6-dic-2021	Deutsche Bank	USD	6.871	4.848	(2.023)
678.000	Compra sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,20 Con vencimiento el 20-dic-2021	Morgan Stanley	USD	7.411	8.860	1.449
(855.000)	Compra sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,20 Con vencimiento el 6-oct-2021	BNP Paribas	USD	(4.897)	(6.651)	(1.754)
667.000	Compra sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,21 Con vencimiento el 5-nov-2021	Bank of America	USD	7.214	5.803	(1.411)
680.000	Compra sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 74,19 Con vencimiento el 10-dic-2021	Barclays Bank	USD	6.800	9.308	2.508
679.000	Compra sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 75,44 Con vencimiento el 21-oct-2021	Barclays Bank	USD	7.642	731	(6.911)
1.537.000	Compra sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 75,84 Con vencimiento el 23-dic-2021	Bank of America	USD	6.472	8.613	2.141
1.391.000	Compra sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 76,50 Con vencimiento el 15-nov-2021	Barclays Bank	USD	6.371	1.738	(4.633)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/(recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
1.262.000	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 109,84 Con vencimiento el 26-nov-2021	Morgan Stanley	USD	13.945	21.533	7.588
1.101.000	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 109,93 Con vencimiento el 8-oct-2021	Citi Bank	USD	13.559	13.999	440
(843.000)	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 111,30 Con vencimiento el 27-oct-2021	Bank of America	USD	(5.522)	(5.100)	422
800.000	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 95,99 Con vencimiento el 17-jun-2024	BNP Paribas	USD	55.269	102.566	47.297
854.000	Compra sobre divisas USD/KRW Precio de ejercicio 1.167,20 Con vencimiento el 8-oct-2021	Barclays Bank	USD	6.888	12.966	6.078
851.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 19,97 Con vencimiento el 14-oct-2021	Morgan Stanley	USD	7.991	29.218	21.227
834.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 20,12 Con vencimiento el 22-oct-2021	Morgan Stanley	USD	9.349	24.804	15.455
1.911.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 20,41 Con vencimiento el 27-oct-2021	Deutsche Bank	USD	21.615	38.151	16.536
1.700.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 20,60 Con vencimiento el 2-dic-2021	Morgan Stanley	USD	37.774	39.590	1.816
680.000	Compra sobre divisas USD/PHP Precio de ejercicio 50,29 Con vencimiento el 9-dic-2021	Barclays Bank	USD	7.303	17.389	10.086
677.000	Compra sobre divisas USD/PHP Precio de ejercicio 50,95 Con vencimiento el 21-oct-2021	Morgan Stanley	USD	7.762	5.729	(2.033)
1.531.000	Compra sobre divisas USD/PHP Precio de ejercicio 51,50 Con vencimiento el 26-nov-2021	Morgan Stanley	USD	7.533	12.843	5.310
(834.000)	Compra sobre divisas USD/RUB Precio de ejercicio 73,13 Con vencimiento el 22-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(9.441)	(6.791)	2.650
1.700.000	Compra sobre divisas USD/RUB Precio de ejercicio 74,95 Con vencimiento el 2-dic-2021	Goldman Sachs	USD	38.343	16.012	(22.331)
740.000	Compra sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 8,54 Con vencimiento el 5-oct-2021	Morgan Stanley	USD	11.781	18.734	6.953
727.000	Compra sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 8,73 Con vencimiento el 17-nov-2021	Morgan Stanley	USD	11.719	9.262	(2.457)
888.000	Compra sobre divisas USD/SGD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 26-nov-2021	J.P. Morgan	USD	7.197	7.804	607
904.000	Compra sobre divisas USD/SGD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 8-oct-2021	Barclays Bank	USD	7.331	4.606	(2.725)
677.000	Compra sobre divisas USD/THB Precio de ejercicio 32,72 Con vencimiento el 14-oct-2021	Barclays Bank	USD	8.138	22.812	14.674
(851.000)	Compra sobre divisas USD/THB Precio de ejercicio 32,91 Con vencimiento el 14-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(6.242)	(23.956)	(17.714)
843.000	Compra sobre divisas USD/TRY Precio de ejercicio 8,80 Con vencimiento el 20-oct-2021	Morgan Stanley	USD	15.039	21.115	6.076
1.229.000	Compra sobre divisas USD/TRY Precio de ejercicio 9,63 Con vencimiento el 17-dic-2021	Goldman Sachs	USD	18.768	23.811	5.043

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
787.000	Compra sobre divisas USD/TWD Precio de ejercicio 27,64 Con vencimiento el 4-ene-2022	J.P. Morgan	USD	7.319	6.881	(438)
843.000	Compra sobre divisas USD/TWD Precio de ejercicio 27,75 Con vencimiento el 27-oct-2021	J.P. Morgan	USD	3.368	3.014	(354)
(852.000)	Compra sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 14,20 Con vencimiento el 12-oct-2021	Bank of America	USD	(13.836)	(49.432)	(35.596)
(854.000)	Compra sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 14,44 Con vencimiento el 5-oct-2021	Barclays Bank	USD	(14.757)	(35.078)	(20.321)
705.000	Compra sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 15,81 Con vencimiento el 14-oct-2021	Citi Bank	USD	9.592	1.338	(8.254)
2.452.000	Compra sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 17,09 Con vencimiento el 22-feb-2022	Citi Bank	USD	46.343	29.642	(16.701)
244	Venta sobre el índice FTSE 100 Precio de ejercicio 7.175,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Goldman Sachs	GBP	21.005	14.615	(6.390)
214	Compra sobre el índice FTSE 100 Precio de ejercicio 7.325,00 Con vencimiento el 17-dic-2021	Goldman Sachs	GBP	22.362	23.688	1.326
50	Compra sobre Global Payments, Inc. Precio de ejercicio 185,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	31.166	4.625	(26.541)
(50)	Compra sobre Global Payments, Inc. Precio de ejercicio 220,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	(3.934)	(875)	3.059
4.095.620	Venta sobre el índice KOSPI 200 Precio de ejercicio 452,74 Con vencimiento el 14-oct-2021	Morgan Stanley	KRW	10.253	1	(10.252)
(105)	Compra sobre el índice S&P Biotechnology Select Industry Precio de ejercicio 11.721,00 Con vencimiento el 21-ene-2022	Barclays Bank	USD	(22.470)	(3.090)	19.380
95.193	Compra sobre Standard Chartered PLC Precio de ejercicio 5,30 Con vencimiento el 17-dic-2021	J.P. Morgan	GBP	9.239	2.634	(6.605)
98.535	Compra sobre Standard Chartered PLC Precio de ejercicio 5,35 Con vencimiento el 17-dic-2021	J.P. Morgan	GBP	9.491	2.431	(7.060)
2.781.916	Compra sobre el índice TOPIX Banks Precio de ejercicio 165,01 Con vencimiento el 10-dic-2021	J.P. Morgan	JPY	60.590	36.041	(24.549)
103.310	Compra sobre UniCredit SpA Precio de ejercicio 12,00 Con vencimiento el 17-dic-2021	Goldman Sachs	EUR	73.143	67.966	(5.177)
(136.000)	Venta sobre Commerzbank AG Precio de ejercicio 4,40 Con vencimiento el 18-mar-2022	Goldman Sachs	EUR	(20.364)	(22.758)	(2.394)
(26)	Venta sobre Facebook, Inc. Precio de ejercicio 300,00 Con vencimiento el 29-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(6.753)	(9.490)	(2.737)
26	Venta sobre Facebook, Inc. Precio de ejercicio 335,00 Con vencimiento el 29-oct-2021	Morgan Stanley	USD	22.897	31.720	8.823
(6.750)	Venta sobre Financial Select Sector SPDR Fund Precio de ejercicio 370,00 Con vencimiento el 17-jun-2022	Morgan Stanley	USD	(85.278)	(82.381)	2.897
(5.136)	Venta sobre Financial Select Sector SPDR Fund Precio de ejercicio 370,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Goldman Sachs	USD	(6.574)	(6.462)	112

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
(3.850)	Venta sobre Financial Select Sector SPDR Fund Precio de ejercicio 383,00 Con vencimiento el 17-dic-2021	Morgan Stanley	USD	(10.010)	(15.768)	(5.758)
(1.155.000)	Venta sobre divisas AUD/JPY Precio de ejercicio 81,12 Con vencimiento el 12-oct-2021	Citi Bank	AUD	(8.554)	(9.800)	(1.246)
(1.155.000)	Venta sobre divisas AUD/JPY Precio de ejercicio 81,58 Con vencimiento el 5-oct-2021	BNP Paribas	AUD	(8.736)	(12.028)	(3.292)
3.355.000	Venta sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,71 Con vencimiento el 20-oct-2021	Morgan Stanley	AUD	19.726	6.686	(13.040)
961.000	Venta sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,60 Con vencimiento el 13-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.830	5.721	(3.109)
959.000	Venta sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,61 Con vencimiento el 27-oct-2021	Bank of America	EUR	8.803	10.127	1.324
(713.000)	Venta sobre divisas EUR/BRL Precio de ejercicio 6,29 Con vencimiento el 26-oct-2021	Bank of America	EUR	(15.491)	(11.103)	4.388
(720.000)	Venta sobre divisas EUR/BRL Precio de ejercicio 6,29 Con vencimiento el 8-oct-2021	Morgan Stanley	EUR	(15.796)	(5.980)	9.816
721.000	Venta sobre divisas EUR/CNH Precio de ejercicio 7,64 Con vencimiento el 12-oct-2021	Citi Bank	EUR	4.335	18.477	14.142
721.000	Venta sobre divisas EUR/CNH Precio de ejercicio 7,67 Con vencimiento el 5-oct-2021	Deutsche Bank	EUR	4.606	22.376	17.770
1.078.000	Venta sobre divisas EUR/JPY Precio de ejercicio 128,50 Con vencimiento el 20-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.535	4.814	(3.721)
713.000	Venta sobre divisas EUR/MXN Precio de ejercicio 23,65 Con vencimiento el 26-oct-2021	Bank of America	EUR	8.264	3.364	(4.900)
720.000	Venta sobre divisas EUR/MXN Precio de ejercicio 23,68 Con vencimiento el 8-oct-2021	Morgan Stanley	EUR	7.853	1.537	(6.316)
840.000	Venta sobre divisas EUR/NZD Precio de ejercicio 1,66 Con vencimiento el 13-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.655	1.682	(6.973)
838.000	Venta sobre divisas EUR/NZD Precio de ejercicio 1,67 Con vencimiento el 20-oct-2021	Citi Bank	EUR	8.966	4.703	(4.263)
730.000	Venta sobre divisas EUR/SEK Precio de ejercicio 10,20 Con vencimiento el 28-oct-2021	Bank of America	EUR	4.460	7.025	2.565
1.030.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,15 Con vencimiento el 14-feb-2022	Morgan Stanley	EUR	7.121	9.729	2.608
2.116.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,15 Con vencimiento el 6-ene-2022	Goldman Sachs	EUR	10.549	15.281	4.732
3.272.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,16 Con vencimiento el 6-ene-2022	Goldman Sachs	EUR	42.452	40.360	(2.092)
1.198.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,17 Con vencimiento el 20-oct-2021	Barclays Bank	EUR	8.639	16.870	8.231
3.228.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,17 Con vencimiento el 21-oct-2021	Citi Bank	EUR	21.589	50.539	28.950
3.645.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,17 Con vencimiento el 21-oct-2021	Morgan Stanley	EUR	25.257	54.587	29.330

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
1.074.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,18 Con vencimiento el 16-nov-2021	Bank of America	EUR	13.705	24.154	10.449
1.028.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,19 Con vencimiento el 31-ene-2022	BNP Paribas	EUR	19.267	36.368	17.101
1.089.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,19 Con vencimiento el 4-oct-2021	Barclays Bank	EUR	14.935	29.490	14.555
1.202.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,19 Con vencimiento el 6-oct-2021	Barclays Bank	EUR	8.398	34.663	26.265
(730.000)	Venta sobre divisas EUR/ZAR Precio de ejercicio 17,70 Con vencimiento el 28-oct-2021	Morgan Stanley	EUR	(14.118)	(19.137)	(5.019)
821.000	Venta sobre divisas GBP/AUD Precio de ejercicio 1,88 Con vencimiento el 27-oct-2021	Bank of America	GBP	8.365	14.315	5.950
720.000	Venta sobre divisas GBP/JPY Precio de ejercicio 152,08 Con vencimiento el 6-oct-2021	Deutsche Bank	GBP	8.140	14.028	5.888
1.298.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,31 Con vencimiento el 29-mar-2022	Morgan Stanley	GBP	15.344	17.791	2.447
889.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,34 Con vencimiento el 20-dic-2021	Citi Bank	GBP	7.049	12.250	5.201
2.434.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,37 Con vencimiento el 20-oct-2021	Citi Bank	GBP	25.437	53.330	27.893
2.085.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,37 Con vencimiento el 21-oct-2021	Barclays Bank	GBP	21.488	46.287	24.799
923.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,38 Con vencimiento el 13-oct-2021	Deutsche Bank	GBP	8.955	31.256	22.301
659.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,38 Con vencimiento el 18-oct-2021	Barclays Bank	GBP	12.378	24.764	12.386
670.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,38 Con vencimiento el 3-dic-2021	Bank of America	GBP	11.803	26.776	14.973
620.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,39 Con vencimiento el 5-oct-2021	Morgan Stanley	GBP	6.278	20.859	14.581
926.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,39 Con vencimiento el 6-oct-2021	BNP Paribas	GBP	8.789	34.674	25.885
3.545.000	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,67 Con vencimiento el 20-oct-2021	Morgan Stanley	NZD	19.967	3.250	(16.717)
775.000	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,70 Con vencimiento el 15-nov-2021	Morgan Stanley	NZD	9.652	13.506	3.854
1.205.000	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,70 Con vencimiento el 27-oct-2021	Morgan Stanley	NZD	9.128	16.568	7.440
(1.205.000)	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,71 Con vencimiento el 8-oct-2021	Morgan Stanley	NZD	(9.769)	(23.284)	(13.515)
(2.444.000)	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,02 Con vencimiento el 12-jul-2022	Deutsche Bank	USD	(54.870)	(26.439)	28.431
(1.856.000)	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,07 Con vencimiento el 8-mar-2022	Deutsche Bank	USD	(30.080)	(15.989)	14.091

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
(2.465.000)	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,09 Con vencimiento el 10-mar-2022	Goldman Sachs	USD	(39.302)	(22.731)	16.571
(2.476.000)	Venta sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,24 Con vencimiento el 14-dic-2021	Deutsche Bank	USD	(11.872)	(8.160)	3.712
1.104.000	Venta sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,91 Con vencimiento el 11-oct-2021	Morgan Stanley	USD	13.855	266	(13.589)
1.081.000	Venta sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,91 Con vencimiento el 26-nov-2021	BNP Paribas	USD	13.480	3.040	(10.440)
(1.852.000)	Venta sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 757,90 Con vencimiento el 10-mar-2022	Citi Bank	USD	(24.110)	(17.051)	7.059
855.000	Venta sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 767,00 Con vencimiento el 6-oct-2021	Bank of America	USD	13.285	4	(13.281)
(2.428.000)	Venta sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 786,70 Con vencimiento el 2-dic-2021	Deutsche Bank	USD	(74.345)	(25.320)	49.025
852.000	Venta sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 791,25 Con vencimiento el 12-oct-2021	Bank of America	USD	13.434	1.488	(11.946)
2.471.000	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,41 Con vencimiento el 11-mar-2022	Goldman Sachs	USD	11.962	10.415	(1.547)
(843.000)	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,50 Con vencimiento el 20-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(4.268)	(6.362)	(2.094)
1.587.000	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,50 Con vencimiento el 9-dic-2021	Barclays Bank	USD	13.521	13.444	(77)
1.579.000	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,52 Con vencimiento el 21-oct-2021	Barclays Bank	USD	13.958	17.194	3.236
670.000	Venta sobre divisas USD/CZK Precio de ejercicio 21,63 Con vencimiento el 30-nov-2021	Morgan Stanley	USD	10.074	4.036	(6.038)
679.000	Venta sobre divisas USD/CZK Precio de ejercicio 21,81 Con vencimiento el 11-oct-2021	J.P. Morgan	USD	11.000	2.401	(8.599)
671.000	Venta sobre divisas USD/IDR Precio de ejercicio 14.370,00 Con vencimiento el 21-dic-2021	Bank of America	USD	9.991	6.972	(3.019)
667.000	Venta sobre divisas USD/IDR Precio de ejercicio 14.510,00 Con vencimiento el 8-nov-2021	Barclays Bank	USD	10.659	9.682	(977)
678.000	Venta sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,20 Con vencimiento el 20-dic-2021	Morgan Stanley	USD	7.411	4.726	(2.685)
(855.000)	Venta sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,20 Con vencimiento el 6-oct-2021	BNP Paribas	USD	(4.897)	(258)	4.639
667.000	Venta sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,21 Con vencimiento el 5-nov-2021	Bank of America	USD	7.214	2.760	(4.454)
2.484.000	Venta sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 72,95 Con vencimiento el 7-dic-2021	Citi Bank	USD	9.191	3.170	(6.021)
680.000	Venta sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 74,19 Con vencimiento el 10-dic-2021	Barclays Bank	USD	6.800	3.334	(3.466)
679.000	Venta sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 75,44 Con vencimiento el 21-oct-2021	Barclays Bank	USD	7.642	9.918	2.276

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
1.262.000	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 109,84 Con vencimiento el 26-nov-2021	Morgan Stanley	USD	13.945	5.332	(8.613)
1.395.000	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 109,86 Con vencimiento el 30-sep-2021	Morgan Stanley	USD	8.537	-	(8.537)
1.101.000	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 109,93 Con vencimiento el 8-oct-2021	Citi Bank	USD	13.559	396	(13.163)
(843.000)	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 111,30 Con vencimiento el 27-oct-2021	Bank of America	USD	(5.522)	(5.160)	362
800.000	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 95,99 Con vencimiento el 17-jun-2024	BNP Paribas	USD	55.269	8.906	(46.363)
669.000	Venta sobre divisas USD/KRW Precio de ejercicio 1.130,00 Con vencimiento el 30-sep-2021	Morgan Stanley	USD	8.774	-	(8.774)
854.000	Venta sobre divisas USD/KRW Precio de ejercicio 1.167,20 Con vencimiento el 8-oct-2021	Barclays Bank	USD	6.888	263	(6.625)
2.471.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 19,50 Con vencimiento el 11-mar-2022	J.P. Morgan	USD	24.176	8.717	(15.459)
2.476.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 19,55 Con vencimiento el 15-dic-2021	Deutsche Bank	USD	16.317	3.291	(13.026)
1.204.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 19,67 Con vencimiento el 9-nov-2021	Morgan Stanley	USD	8.840	699	(8.141)
851.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 19,97 Con vencimiento el 14-oct-2021	Morgan Stanley	USD	7.991	273	(7.718)
834.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 20,12 Con vencimiento el 22-oct-2021	Morgan Stanley	USD	9.349	1.157	(8.192)
1.235.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 20,17 Con vencimiento el 6-ene-2022	Morgan Stanley	USD	9.727	9.104	(623)
1.700.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 20,60 Con vencimiento el 2-dic-2021	Morgan Stanley	USD	37.774	21.451	(16.323)
680.000	Venta sobre divisas USD/PHP Precio de ejercicio 50,29 Con vencimiento el 9-dic-2021	Barclays Bank	USD	7.303	1.296	(6.007)
677.000	Venta sobre divisas USD/PHP Precio de ejercicio 50,95 Con vencimiento el 21-oct-2021	Morgan Stanley	USD	7.762	2.282	(5.480)
2.427.000	Venta sobre divisas USD/RUB Precio de ejercicio 72,14 Con vencimiento el 28-feb-2022	Citi Bank	USD	25.423	26.016	593
1.216.000	Venta sobre divisas USD/RUB Precio de ejercicio 72,25 Con vencimiento el 26-ene-2022	Citi Bank	USD	14.002	12.314	(1.688)
(834.000)	Venta sobre divisas USD/RUB Precio de ejercicio 73,13 Con vencimiento el 22-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(9.441)	(8.573)	868
1.700.000	Venta sobre divisas USD/RUB Precio de ejercicio 74,95 Con vencimiento el 2-dic-2021	Goldman Sachs	USD	36.305	50.179	13.874
740.000	Venta sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 8,54 Con vencimiento el 5-oct-2021	Morgan Stanley	USD	11.781	5	(11.776)
727.000	Venta sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 8,73 Con vencimiento el 17-nov-2021	Morgan Stanley	USD	11.719	7.045	(4.674)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
888.000	Venta sobre divisas USD/SGD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 26-nov-2021	J.P. Morgan	USD	7.197	3.575	(3.622)
904.000	Venta sobre divisas USD/SGD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 8-oct-2021	Barclays Bank	USD	7.331	599	(6.732)
677.000	Venta sobre divisas USD/THB Precio de ejercicio 32,72 Con vencimiento el 14-oct-2021	Barclays Bank	USD	8.138	37	(8.101)
(851.000)	Venta sobre divisas USD/THB Precio de ejercicio 32,91 Con vencimiento el 14-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(6.242)	(103)	6.139
(1.229.000)	Venta sobre divisas USD/TRY Precio de ejercicio 8,57 Con vencimiento el 17-dic-2021	Goldman Sachs	USD	(12.182)	(4.818)	7.364
(1.823.000)	Venta sobre divisas USD/TRY Precio de ejercicio 8,79 Con vencimiento el 17-dic-2021	Morgan Stanley	USD	(17.783)	(15.309)	2.474
843.000	Venta sobre divisas USD/TRY Precio de ejercicio 8,80 Con vencimiento el 20-oct-2021	Morgan Stanley	USD	15.039	4.337	(10.702)
787.000	Venta sobre divisas USD/TWD Precio de ejercicio 27,64 Con vencimiento el 4-ene-2022	J.P. Morgan	USD	7.319	7.091	(228)
843.000	Venta sobre divisas USD/TWD Precio de ejercicio 27,75 Con vencimiento el 27-oct-2021	J.P. Morgan	USD	3.368	3.083	(285)
(852.000)	Venta sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 14,20 Con vencimiento el 12-oct-2021	Bank of America	USD	(13.836)	(198)	13.638
(854.000)	Venta sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 14,44 Con vencimiento el 5-oct-2021	Barclays Bank	USD	(14.757)	(43)	14.714
(2.452.000)	Venta sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 14,67 Con vencimiento el 22-feb-2022	Citi Bank	USD	(35.915)	(46.853)	(10.938)
(37)	Venta sobre Global Payments, Inc. Precio de ejercicio 145,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	(12.202)	(11.655)	547
71	Venta sobre opciones en euros del mercado monetario internacional - Futuros Precio de ejercicio 99,25 Con vencimiento el 13-mar-2023	Morgan Stanley	USD	32.516	28.400	(4.116)
227	Venta sobre opciones en euros del mercado monetario internacional - Futuros Precio de ejercicio 99,50 Con vencimiento el 19-sep-2022	Morgan Stanley	USD	32.389	26.956	(5.433)
(20)	Venta sobre el índice MSCI EAFE Precio de ejercicio 2.050,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(14.398)	(9.000)	5.398
20	Venta sobre el índice MSCI EAFE Precio de ejercicio 2.275,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Morgan Stanley	USD	55.286	70.000	14.714
(9)	Venta sobre el índice NASDAQ-100 Reduced Value Precio de ejercicio 2.550,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	(18.180)	(19.395)	(1.215)
(11)	Venta sobre el índice NASDAQ-100 Reduced Value Precio de ejercicio 2.675,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(16.628)	(7.865)	8.763
6	Venta sobre el índice NASDAQ-100 Reduced Value Precio de ejercicio 2.910,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	34.868	53.550	18.682
9	Venta sobre el índice NASDAQ-100 Reduced Value Precio de ejercicio 2.915,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	70.275	81.945	11.670

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
11	Venta sobre el índice NASDAQ-100 Reduced Value Precio de ejercicio 2.975,00 Con vencimiento el 15-oct-2021	Morgan Stanley	USD	54.355	77.385	23.030
(32)	Venta sobre el índice Russell 2000 Precio de ejercicio 1.980,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	(70.626)	(80.160)	(9.534)
32	Venta sobre el índice Russell 2000 Precio de ejercicio 2.210,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	202.772	269.280	66.508
(7)	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 3.700,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	(15.027)	(14.280)	747
(8)	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 3.850,00 Con vencimiento el 30-sep-2021	Morgan Stanley	USD	(9.853)	(40)	9.813
(29)	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.000,00 Con vencimiento el 29-oct-2021	Morgan Stanley	USD	(59.143)	(82.215)	(23.072)
4	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.200,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	27.253	35.880	8.627
7	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.300,00 Con vencimiento el 19-nov-2021	Morgan Stanley	USD	59.453	83.755	24.302
29	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.325,00 Con vencimiento el 29-oct-2021	Morgan Stanley	USD	194.381	292.465	98.084
8	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 4.350,00 Con vencimiento el 30-sep-2021	Morgan Stanley	USD	46.727	31.120	(15.607)
105	Venta sobre el índice S&P Biotechnology Select Industry Precio de ejercicio 9.280,00 Con vencimiento el 21-ene-2022	Barclays Bank	USD	62.370	33.350	(29.020)
				USD	2.855.861	(33.838)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaptions

Las swaptions se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. El valor de mercado se muestra en el Balance en el epígrafe "Opciones y swaptions a valor de mercado".

A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos estaban comprometidos con swaptions pendientes sobre índices financieros y participaciones internacionales cotizadas:

Posición de protección	Descripción	Contraparte	Divisa	Prima	Cantidad nominal	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Compra	IRS "Paga tipo fijo al 1,50% Recibe tipo variable USD LIBOR Jul 2023", Venta 1,50%, 19-jul-2023	Bank of America	USD	355.559	9.795.000	541.284	185.725	
Compra	IRS "Paga tipo fijo al 7,69% Recibe tipo variable MXN TIIE Mar 2026", Venta 7,69%, 13-mar-2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	222.640	(161.484)	
Compra	IRS "Paga tipo fijo al 8,50% Recibe tipo variable MXN TIIE Abr 2028", Venta 8,50%, 06-abr-2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	45.932	(49.993)	
Venta	IRS "Recibe tipo fijo al 4,80% Paga tipo variable MXN TIIE Abr 2022", Compra 4,80%, 26-abr-2022	J.P. Morgan	MXN	(14.729)	(273.960.000)	(82)	14.647	
Venta	IRS "Recibe tipo fijo al 4,86% Paga tipo variable MXN TIIE Mar 2022", Compra 4,86%, 23-mar-2022	J.P. Morgan	MXN	(27.657)	(547.915.000)	(114)	27.543	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 5,30% Paga tipo variable MXN TIIE Abr 2022", Compra 5,30%, 26-abr-2022	J.P. Morgan	MXN	49.542	273.960.000	428	(49.114)	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 5,36% Paga tipo variable MXN TIIE Mar 2022", Compra 5,36%, 23-mar-2022	J.P. Morgan	MXN	86.920	547.915.000	795	(86.125)	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 5,97% Paga tipo variable MXN TIIE Mar 2023", Compra 5,97%, 30-mar-2023	J.P. Morgan	MXN	69.383	46.495.000	2.627	(66.756)	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 6,25% Paga tipo variable MXN TIIE Feb 2022", Compra 6,25%, 21-feb-2022	J.P. Morgan	MXN	67.565	67.710.000	1.824	(65.741)	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 6,80% Paga tipo variable MXN TIIE Feb 2025", Compra 6,80%, 07-feb-2025	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	93.533	(448.143)	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 7,08% Paga tipo variable ZAR JIBAR Mar 2021", Compra 7,08%, 08-nov-2021	J.P. Morgan	ZAR	156.324	84.425.000	893	(155.431)	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 7,29% Paga tipo variable MXN TIIE Mar 2026", Compra 7,29%, 05-mar-2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	114.656	(281.868)	
Compra	IRS "Recibe tipo fijo al 8,50% Paga tipo variable MXN TIIE Abr 2028", Compra 8,50%, 06-abr-2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	41.343	(54.582)	
						USD	1.065.759	(1.191.322)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total

El Fondo puede emplear swaps de rentabilidad total. Un swap de rentabilidad total es un contrato financiero bilateral que permite al Fondo disfrutar de todos los beneficios de flujo de caja de un activo sin poseer realmente ese activo (el "Activo de referencia"). Los subfondos deberán pagar una comisión periódica (pago fijo o variable) a cambio de su derecho de recibir la rentabilidad total de los Activos de referencia (cupones, plusvalías y/o minusvalías). El Activo de referencia puede ser prácticamente cualquier activo que sea una inversión apta para los subfondos. Por su parte, los subfondos pueden emplear dichos instrumentos para ganar exposición en un mercado apto o para fines de cobertura.

Los swaps de rentabilidad total se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. Las ganancias o las pérdidas latentes sobre los swaps de rentabilidad total al final del ejercicio están representados por los valores de los intereses por percibir (o pagar), sobre la base de los tipos de interés de los correspondientes acuerdos de swap, menos (o más, respectivamente) el valor del rendimiento por pagar (o percibir, respectivamente), sobre la base del valor de rentabilidad total de los activos subyacentes, que se calcula a partir del valor razonable actual de la renta variable más el dividendo distribuido por tal renta variable para el ejercicio del swap correspondiente. La plusvalía/(minusvalía) latente se muestra en el Balance en el epígrafe "Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de rentabilidad total".

A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos formaban parte de contratos de swaps de rentabilidad total:

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Egerton Equity							
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	Morgan Stanley	EUR	16.542.537	10.813.613	03-dic-2021	12.462.433
Compra en largo	Líneas aéreas	J.P. Morgan	EUR	34.027.867	(470.858)	21-ene-2022	2.630.680
Compra en largo	Ropa	J.P. Morgan	EUR	3.701.913	376.542	06-may-2022	1.049.294
Compra en largo	Fabricantes de automóviles	J.P. Morgan	EUR	17.787.883	7.454.222	27-dic-2021	7.548.604
Compra en largo	Bancos	UBS	EUR	2.976.416	87.896	30-abr-2024	87.896
Compra en largo	Constructores de viviendas	Goldman Sachs	GBP	25.831.529	(4.511.771)	07-ago-2024	(4.511.771)
Compra en largo	Constructores de viviendas	Morgan Stanley	GBP	8.375.076	1.174.518	08-dic-2021	1.348.484
Compra en largo	Seguros	Goldman Sachs	GBP	26.591.360	809.505	07-ago-2024	825.201
Compra en largo	Ventas minoristas	Goldman Sachs	CHF	14.992.496	(1.895.523)	18-jun-2024	(1.895.523)
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	Goldman Sachs	EUR	2.491.374	(271.860)	24-jul-2024	(272.885)
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	J.P. Morgan	USD	6.992.571	455.200	25-feb-2022	(78.327)
Venta en corto	Ropa	Merrill Lynch	USD	1.806.869	121.273	31-oct-2022	121.273
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Merrill Lynch	USD	1.754.421	(663.648)	31-oct-2022	(547.053)
Venta en corto	Piezas y equipamiento de automóviles	Goldman Sachs	EUR	1.915.749	293.420	18-sep-2024	293.418
Venta en corto	Piezas y equipamiento de automóviles	Morgan Stanley	EUR	1.959.959	61.012	03-dic-2021	61.217
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	HKD	2.491.026	(105.473)	23-dic-2022	(105.473)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	JPY	923.774	(27.517)	24-oct-2022	(27.618)
Venta en corto	Bebidas	Goldman Sachs	EUR	1.952.190	(20.665)	18-sep-2024	(20.665)
Venta en corto	Bebidas	Morgan Stanley	EUR	2.050.038	107.424	03-dic-2021	129.818
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	990.877	(1.241.274)	26-abr-2023	(1.263.481)
Venta en corto	Productos químicos	Goldman Sachs	DKK	3.746.328	259.372	13-feb-2024	258.855
Venta en corto	Productos químicos	J.P. Morgan	USD	5.417.971	(65.770)	09-mar-2022	(68.614)
Venta en corto	Servicios comerciales	Merrill Lynch	USD	3.284.365	215.252	31-oct-2022	251.189
Venta en corto	Informática	Goldman Sachs	CHF	1.481.628	165.398	11-sep-2024	165.398
Venta en corto	Informática	Goldman Sachs	USD	6.233.250	(298.936)	14-jun-2023	(529.832)
Venta en corto	Informática	Morgan Stanley	EUR	3.697.252	284.588	03-dic-2021	404.819
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Morgan Stanley	JPY	8.501.339	(369.824)	24-oct-2022	(796.799)
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Morgan Stanley	USD	3.506.456	168.039	25-sep-2023	168.039
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	DKK	5.615.457	688.570	04-abr-2024	689.188
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	USD	3.180.575	665.476	05-mar-2024	669.676
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Goldman Sachs	USD	868.186	236.871	28-feb-2024	237.002
Venta en corto	Electrónica	J.P. Morgan	USD	1.958.000	12.680	31-oct-2022	12.680
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Goldman Sachs	DKK	3.057.020	(260.558)	24-abr-2024	(255.574)
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Goldman Sachs	NOK	935.850	309.892	10-jul-2024	311.509
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	USD	2.814.618	221.506	13-jul-2022	191.461
Venta en corto	Entretenimiento	Merrill Lynch	USD	2.006.929	92.843	31-oct-2022	8.734
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	5.793.022	673.452	16-ene-2024	595.087
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	3.974.122	618.053	21-mar-2024	746.869
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	2.940.613	(260.271)	28-ago-2024	(260.271)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)							
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	1.912.570	(15.324)	17-sep-2024	(15.324)
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	203.247	1.155	02-oct-2024	1.155
Venta en corto	Alimentos	Morgan Stanley	GBP	996.242	28.734	08-dic-2021	32.335
Venta en corto	Servicios alimenticios	Goldman Sachs	USD	2.926.153	145.751	24-jul-2024	146.166
Venta en corto	Gas	Morgan Stanley	HKD	6.275.734	223.214	23-dic-2022	240.902
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	DKK	4.773.140	738.476	15-may-2024	748.471
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	SEK	3.022.973	56.494	26-abr-2023	32.049
Venta en corto	Salud (productos)	Merrill Lynch	USD	4.993.476	765.485	31-oct-2022	786.553
Venta en corto	Salud (servicios)	Merrill Lynch	USD	3.653.950	364.382	31-oct-2022	359.871
Venta en corto	Productos/artículos para el hogar	Goldman Sachs	USD	5.458.822	164.444	31-jul-2024	174.238
Venta en corto	Seguros	Merrill Lynch	USD	3.030.994	784.023	31-oct-2022	795.006
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	USD	1.887.748	153.577	07-feb-2024	380.114
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	USD	2.670.300	1.859.257	07-mar-2024	1.878.059
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	USD	5.265.860	268.530	13-sep-2022	270.786
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	USD	2.465.422	106.641	20-oct-2022	106.641
Venta en corto	Tiempo libre	J.P. Morgan	USD	6.532.810	274.932	24-oct-2022	274.932
Venta en corto	Maquinaria (construcción y minería)	Goldman Sachs	EUR	3.367.818	27.344	26-sep-2024	27.344
Venta en corto	Maquinaria (construcción y minería)	Morgan Stanley	USD	973.683	273.360	13-jul-2022	273.676
Venta en corto	Fabricación diversa	Goldman Sachs	CHF	3.508.421	56.151	24-jul-2024	56.504
Venta en corto	Fabricación diversa	Merrill Lynch	USD	2.966.788	413.943	31-oct-2022	414.469
Venta en corto	Fabricación diversa	Morgan Stanley	EUR	3.833.361	747.012	03-dic-2021	742.406
Venta en corto	Equipamiento de oficina y empresarial	Morgan Stanley	JPY	3.736.494	(86.890)	24-oct-2022	(87.008)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Morgan Stanley	GBP	3.568.989	(360.692)	08-dic-2021	(418.013)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Merrill Lynch	USD	2.549.419	(134.725)	31-oct-2022	(134.725)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	3.853.816	106.739	25-sep-2023	106.739
Venta en corto	REIT	Merrill Lynch	USD	3.939.155	774.777	31-oct-2022	773.112
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	EUR	937.514	(249.316)	03-dic-2021	(220.052)
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	CHF	2.456.304	117.532	21-ago-2024	117.532
Venta en corto	Semiconductores	Goldman Sachs	USD	944.983	102.662	05-sep-2024	103.320
Venta en corto	Semiconductores	J.P. Morgan	USD	10.774.595	381.182	31-may-2022	428.453
Venta en corto	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	1.526.234	199.465	31-oct-2022	199.248
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	CHF	1.991.725	68.711	25-sep-2024	68.711
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	SEK	3.650.839	854.138	28-feb-2024	861.344
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	3.178.543	(187.868)	22-feb-2024	(181.252)
Venta en corto	Software	J.P. Morgan	USD	2.013.844	598.497	29-jul-2022	250.241
Venta en corto	Software	J.P. Morgan	USD	5.921.209	155.861	31-oct-2022	155.861
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	7.737.175	(1.377.953)	31-oct-2022	(1.362.309)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	PLN	3.786.389	203.913	13-jul-2022	478.411
Venta en corto	Telecomunicaciones	Goldman Sachs	USD	9.782.589	751.376	02-oct-2023	766.803
Venta en corto	Telecomunicaciones	Goldman Sachs	USD	4.901.821	318.545	26-jun-2024	318.545
Venta en corto	Varios*	Morgan Stanley	USD	26.340.083	757.920	17-may-2023	971.758
EUR							31.558.010
Schroder GAIA Helix							
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	EUR	151.311.884	1.335.348	06-sep-2022	1.335.348
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	EUR	35.412.099	1.026.456	30-sep-2021	1.026.456
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	GBP	18.214.671	(48.024)	06-sep-2022	(48.024)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	JPY	147.381.765	636.553	06-sep-2022	636.553
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	JPY	3.502.279	(52.497)	30-sep-2021	(52.497)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	567.132.151	5.289.221	06-sep-2022	5.141.065
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	328.083.820	14.870.092	30-sep-2021	14.870.092

* El contrato se mantiene en una cesta de varios valores estadounidenses.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Helix (continuación)							
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	JPY	94.849.123	152.617	06-sep-2022	152.617
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	JPY	124.460.784	1.657.460	30-sep-2021	1.657.460
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	466.611.237	2.110.462	06-sep-2022	2.110.462
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	299.629.091	1.185.729	30-sep-2021	1.185.729
						USD	28.015.261
Schroder GAIA Sirios US Equity							
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	USD	1.698.826	47.255	12-may-2022	47.255
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	14.541.856	1.776.414	12-may-2022	1.776.414
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	12.341.186	(1.250.242)	12-ago-2022	(1.256.391)
Compra en largo	Semiconductores	Goldman Sachs	USD	20.665.385	(337.780)	15-nov-2022	(344.367)
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	USD	2.392.270	91.131	15-nov-2022	91.131
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	Credit Suisse	USD	1.414.155	(67.091)	12-may-2022	(67.091)
Venta en corto	Agricultura	Merrill Lynch	USD	485.076	81.156	12-sep-2022	81.156
Venta en corto	Agricultura	Morgan Stanley	USD	174.515	29.197	26-may-2022	29.197
Venta en corto	Ropa	Credit Suisse	USD	570.821	121.029	12-may-2022	121.029
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Credit Suisse	USD	511.039	9.028	12-may-2022	9.028
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	USD	1.076.431	87.575	14-feb-2023	115.947
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Merrill Lynch	USD	177.908	(4.866)	13-may-2022	(4.866)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Merrill Lynch	USD	721.453	(279.798)	14-jul-2022	(279.798)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	USD	640.200	(125.826)	26-may-2022	(125.826)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	USD	2.331.149	43.021	12-ago-2022	43.555
Venta en corto	Bancos	Merrill Lynch	USD	721.512	(28.221)	24-ene-2022	(28.221)
Venta en corto	Bancos	Merrill Lynch	USD	2.309.070	124.385	23-mar-2022	124.331
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	USD	685.184	64.179	15-nov-2022	64.995
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	USD	1.119.699	(27.328)	12-may-2023	(27.363)
Venta en corto	Materiales de construcción	Merrill Lynch	USD	559.393	14.141	19-ago-2022	14.141
Venta en corto	Productos químicos	Merrill Lynch	USD	760.365	69.739	13-may-2022	69.739
Venta en corto	Productos químicos	Merrill Lynch	USD	952.421	(8.501)	19-ago-2022	(8.501)
Venta en corto	Informática	Credit Suisse	USD	827.604	(60.184)	12-may-2022	(59.233)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Merrill Lynch	USD	514.273	2.216	27-oct-2022	2.216
Venta en corto	Electrónica	Credit Suisse	USD	1.907.387	211.666	12-may-2022	212.201
Venta en corto	Control medioambiental	Goldman Sachs	USD	510.612	82.253	15-nov-2022	82.253
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	22.803.071	753.430	28-feb-2022	753.430
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	20.556.504	146.730	07-abr-2022	142.586
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	21.542.992	711.117	26-may-2022	711.117
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	10.152.997	780.212	25-jul-2022	780.212
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	25.850.725	1.253.257	01-ago-2022	1.253.257
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	16.809.569	658.692	08-sep-2022	658.692
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	1.672.933	38.833	14-feb-2023	38.917
Venta en corto	Alimentos	Merrill Lynch	USD	1.396.116	64.374	24-mar-2022	64.374
Venta en corto	Alimentos	Merrill Lynch	USD	746.550	28.444	29-abr-2022	28.444
Venta en corto	Alimentos	Merrill Lynch	USD	1.670.914	18.185	24-jun-2022	18.185
Venta en corto	Alimentos	Merrill Lynch	USD	521.336	(6.560)	26-sep-2022	(6.139)
Venta en corto	Salud (productos)	Merrill Lynch	USD	414.412	49.001	09-may-2022	49.001
Venta en corto	Mobiliario del hogar	Merrill Lynch	USD	1.468.112	39.869	20-oct-2022	39.869
Venta en corto	Seguros	Merrill Lynch	USD	2.842.986	229.604	26-abr-2022	229.604
Venta en corto	Seguros	Merrill Lynch	USD	368.778	46.045	09-may-2022	46.045

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)								
Venta en corto	Internet	Merrill Lynch	USD	942.918	38.890	19-abr-2022	38.890	
Venta en corto	Internet	Merrill Lynch	USD	410.163	(77.425)	22-ago-2022	(77.425)	
Venta en corto	Tiempo libre	Morgan Stanley	USD	1.414.199	277.900	26-may-2022	279.502	
Venta en corto	Maquinaria (construcción y minería)	Merrill Lynch	USD	1.025.485	22.771	21-oct-2022	22.771	
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Goldman Sachs	USD	1.369.838	15.060	12-may-2023	15.060	
Venta en corto	Medios de comunicación	Credit Suisse	USD	684.600	20.832	12-may-2022	20.832	
Venta en corto	Petróleo y gas	Merrill Lynch	USD	989.358	(36.504)	18-ene-2022	(36.504)	
Venta en corto	Embalaje y contenedores	Credit Suisse	USD	2.024.631	93.857	12-may-2022	93.857	
Venta en corto	Embalaje y contenedores	Goldman Sachs	USD	1.073.731	32.347	12-may-2022	32.347	
Venta en corto	Embalaje y contenedores	Merrill Lynch	USD	516.618	38.072	24-jun-2022	38.072	
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Merrill Lynch	USD	740.486	(45.352)	07-feb-2022	(45.352)	
Venta en corto	REIT	Credit Suisse	USD	833.075	56.747	12-may-2022	56.747	
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	308.829	42.656	28-mar-2022	42.656	
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	USD	3.429.485	118.811	12-may-2022	121.021	
Venta en corto	Ventas minoristas	Merrill Lynch	USD	981.275	127.455	25-mar-2022	127.455	
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	3.447.919	63.396	26-may-2022	63.396	
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	929.792	41.693	15-nov-2022	38.652	
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	1.051.764	172.728	14-feb-2023	172.490	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	849.747	(1.933)	14-feb-2022	(1.933)	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	996.954	135.821	19-abr-2022	129.157	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	660.772	(150.225)	15-jul-2022	(150.225)	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	462.690	14.697	19-sep-2022	14.697	
Venta en corto	Telecomunicaciones	Credit Suisse	USD	2.824.655	161.651	12-may-2022	162.261	
							USD	6.648.949
Schroder GAIA Two Sigma Diversified								
Compra en largo	Varios*	Morgan Stanley	USD	788.161.293	(9.790.355)	21-oct-2021	(9.790.394)	
							USD	(9.790.394)
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	Goldman Sachs	EUR	10.224	188	24-may-2023	188	
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	J.P. Morgan	EUR	47.159	2.407	09-may-2023	2.407	
Compra en largo	Agricultura	Goldman Sachs	GBP	283.723	(9.645)	24-may-2023	(9.645)	
Compra en largo	Agricultura	J.P. Morgan	GBP	19.999	(1.932)	09-may-2023	(1.932)	
Compra en largo	Líneas aéreas	J.P. Morgan	GBP	321.983	251	07-may-2023	251	
Compra en largo	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	USD	31.321	(899)	24-may-2023	(899)	
Compra en largo	Fabricantes de automóviles	J.P. Morgan	USD	169.420	(13.467)	09-may-2023	(13.467)	
Compra en largo	Piezas y equipamiento de automóviles	Goldman Sachs	USD	47.670	524	24-may-2023	524	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	CZK	7.381	341	24-may-2023	341	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	EUR	1.928.303	223.425	24-may-2023	223.425	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	GBP	165.605	9.949	24-may-2023	9.949	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	JPY	441.058	16.338	24-may-2023	16.338	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	USD	3.657.438	401.861	24-may-2023	401.861	
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	EUR	174.645	15.838	20-jul-2022	15.838	
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	EUR	546.889	28.191	09-may-2023	28.191	
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	GBP	127.463	(6.320)	09-may-2023	(6.320)	
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	USD	1.985.310	(35.336)	09-may-2023	(35.336)	
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	CZK	564.332	25.434	15-may-2023	25.434	
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	EUR	1.227.290	95.537	15-may-2023	95.537	

* El contrato se mantiene en una cesta de varios valores estadounidenses.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	SEK	1.000.105	31.799	15-may-2023	33.142
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	USD	1.545.632	90.174	15-may-2023	90.174
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	DKK	140.836	3.504	24-may-2023	3.504
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	HKD	3.592	(387)	24-may-2023	(387)
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	2.290.628	(42.168)	24-may-2023	(42.168)
Compra en largo	Biotecnología	J.P. Morgan	CHF	343.483	(9.394)	09-may-2023	(9.394)
Compra en largo	Biotecnología	J.P. Morgan	USD	619.041	(82.928)	09-may-2023	(82.928)
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	DKK	366.325	14.283	15-may-2023	14.283
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	1.978.619	(67.347)	15-may-2023	(67.347)
Compra en largo	Materiales de construcción	Goldman Sachs	USD	22.619	(1.446)	24-may-2023	(1.446)
Compra en largo	Materiales de construcción	Morgan Stanley	HKD	21.761	(2.806)	15-may-2023	(2.806)
Compra en largo	Materiales de construcción	Morgan Stanley	USD	26.747	(2.715)	15-may-2023	(2.715)
Compra en largo	Productos químicos	Goldman Sachs	USD	112.448	(334)	24-may-2023	(334)
Compra en largo	Productos químicos	J.P. Morgan	EUR	606.452	(29.392)	09-may-2023	(29.392)
Compra en largo	Productos químicos	J.P. Morgan	JPY	230.059	(13.140)	22-jun-2022	(13.140)
Compra en largo	Productos químicos	Morgan Stanley	USD	313.454	21.458	25-sep-2023	21.458
Compra en largo	Carbón	Goldman Sachs	AUD	205.480	35.893	24-may-2023	35.893
Compra en largo	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	2.757.369	(98.563)	24-may-2023	(98.563)
Compra en largo	Servicios comerciales	J.P. Morgan	EUR	1.019.538	(33.051)	09-may-2023	(33.051)
Compra en largo	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	2.235.001	(76.000)	09-may-2023	(76.000)
Compra en largo	Servicios comerciales	Morgan Stanley	CAD	320.363	(37.474)	15-may-2023	(37.474)
Compra en largo	Servicios comerciales	Morgan Stanley	EUR	5.965	(215)	15-may-2023	(215)
Compra en largo	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	729.811	(25.594)	15-may-2023	(25.594)
Compra en largo	Informática	Goldman Sachs	USD	2.188	(52)	25-may-2023	(52)
Compra en largo	Informática	Morgan Stanley	USD	77.236	(8.475)	15-may-2023	(8.475)
Compra en largo	Distribución/venta mayorista	Morgan Stanley	USD	71.304	(1.805)	15-may-2023	(1.805)
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	GBP	556.790	3.886	24-may-2023	3.886
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	3.106.830	66.053	24-may-2023	66.053
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	USD	1.373.412	56.349	09-may-2023	56.349
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	EUR	846.006	77.207	15-may-2023	77.207
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	2.049.237	11.697	15-may-2023	11.697
Compra en largo	Eléctrico	Goldman Sachs	EUR	470.688	(10.979)	24-may-2023	(10.979)
Compra en largo	Eléctrico	Goldman Sachs	USD	747.501	(36.375)	24-may-2023	(36.375)
Compra en largo	Eléctrico	J.P. Morgan	EUR	93.897	(5.438)	09-may-2023	(5.438)
Compra en largo	Eléctrico	J.P. Morgan	HKD	355.904	67.217	20-oct-2023	67.217
Compra en largo	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	188.689	(9.168)	09-may-2023	(9.168)
Compra en largo	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	7.947	(560)	15-may-2023	(560)
Compra en largo	Componentes y equipos eléctricos	Goldman Sachs	USD	145.055	9.520	25-may-2023	9.520
Compra en largo	Componentes y equipos eléctricos	J.P. Morgan	EUR	271.253	(18.390)	22-jun-2022	(18.390)
Compra en largo	Componentes y equipos eléctricos	Morgan Stanley	USD	8.174	(39)	15-may-2023	(39)
Compra en largo	Electrónica	Goldman Sachs	USD	588.210	(47.410)	24-may-2023	(47.410)
Compra en largo	Electrónica	Goldman Sachs	USD	2.498	(155)	25-may-2023	(155)
Compra en largo	Electrónica	J.P. Morgan	USD	628.062	(71.351)	09-may-2023	(71.351)
Compra en largo	Electrónica	Morgan Stanley	USD	240.256	(36.106)	15-may-2023	(36.106)
Compra en largo	Fuentes alternativas de energía	Goldman Sachs	USD	284.918	(21.334)	25-may-2023	(21.334)
Compra en largo	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	NOK	32.278	4.236	09-may-2023	4.236
Compra en largo	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	NOK	94.125	10.345	15-may-2023	10.345

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Compra en largo	Ingeniería y construcción	Goldman Sachs	USD	256.188	19.694	24-may-2023	19.694
Compra en largo	Entretenimiento	Goldman Sachs	GBP	484.095	(2.591)	24-may-2023	(2.591)
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	4.350	(264)	15-may-2023	(264)
Compra en largo	Índice de renta variable	J.P. Morgan	JPY	943.945	(3.436)	02-may-2022	(3.436)
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	365.484	(4.006)	15-may-2023	(4.006)
Compra en largo	Servicios alimenticios	Morgan Stanley	EUR	175.505	17.896	15-may-2023	17.896
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	EUR	495.142	(19.362)	24-may-2023	(19.362)
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	GBP	42.491	(1.126)	24-may-2023	(1.126)
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	HKD	4.410	157	24-may-2023	157
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	4.854.957	(198.558)	24-may-2023	(198.558)
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	174.535	15.639	25-may-2023	15.639
Compra en largo	Salud (productos)	J.P. Morgan	EUR	5.797	(340)	09-may-2023	(340)
Compra en largo	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	1.861.593	(70.584)	22-ago-2022	(70.584)
Compra en largo	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	1.693.334	(92.233)	09-may-2023	(92.233)
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	CHF	205.683	(17.277)	15-may-2023	(17.277)
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	EUR	26.842	(718)	15-may-2023	(718)
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	GBP	185.412	(4.670)	15-may-2023	(4.670)
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	HKD	167.810	5.523	15-may-2023	5.523
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	550.382	(40.881)	15-may-2023	(40.881)
Compra en largo	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	4.912.826	(161.068)	24-may-2023	(161.068)
Compra en largo	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	627.648	(45.445)	22-jun-2022	(45.445)
Compra en largo	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	181.294	(10.128)	22-ago-2022	(10.128)
Compra en largo	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	1.575.540	(118.514)	09-may-2023	(118.514)
Compra en largo	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	1.343.268	(103.601)	15-may-2023	(103.601)
Compra en largo	Sociedades de control (varios)	Goldman Sachs	USD	86.220	176	24-may-2023	176
Compra en largo	Constructores de viviendas	Goldman Sachs	USD	256.680	(6.617)	24-may-2023	(6.617)
Compra en largo	Constructores de viviendas	Morgan Stanley	USD	157.422	(7.627)	15-may-2023	(7.627)
Compra en largo	Mobiliario del hogar	Morgan Stanley	JPY	236.717	(8.410)	15-may-2023	(8.410)
Compra en largo	Seguros	Goldman Sachs	CAD	293.740	(4.136)	25-may-2023	(4.136)
Compra en largo	Seguros	Goldman Sachs	JPY	696.744	4.011	24-may-2023	4.011
Compra en largo	Seguros	Goldman Sachs	USD	19.216	247	24-may-2023	247
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	GBP	294.026	(8.688)	09-may-2023	(8.688)
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	JPY	65.207	5.472	09-may-2023	5.472
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	USD	36.582	(769)	09-may-2023	(769)
Compra en largo	Seguros	Morgan Stanley	HKD	157.237	(87)	15-may-2023	(87)
Compra en largo	Seguros	Morgan Stanley	JPY	114.122	3.906	15-may-2023	3.906
Compra en largo	Seguros	Morgan Stanley	USD	86.430	(2.549)	15-may-2023	(2.549)
Compra en largo	Internet	Goldman Sachs	USD	192.672	17.552	24-may-2023	17.552
Compra en largo	Internet	J.P. Morgan	USD	310.606	(22.257)	20-oct-2022	(22.257)
Compra en largo	Internet	J.P. Morgan	USD	227.247	(3.380)	09-may-2023	(3.380)
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	1.324.553	(79.758)	15-may-2023	(79.758)
Compra en largo	Sociedades de inversión	Morgan Stanley	ZAR	499.536	104.142	15-may-2023	104.142
Compra en largo	Maquinaria (diversificado)	Goldman Sachs	USD	1.079.067	34.161	24-may-2023	34.161
Compra en largo	Maquinaria (diversificado)	Goldman Sachs	USD	4.697	28	25-may-2023	28
Compra en largo	Medios de comunicación	J.P. Morgan	USD	436.294	(18.643)	09-may-2023	(18.643)
Compra en largo	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	84.647	925	27-dic-2021	925
Compra en largo	Metalurgia	Morgan Stanley	EUR	67.279	1.161	15-may-2023	1.161
Compra en largo	Minería	Goldman Sachs	GBP	180.027	13.303	24-may-2023	13.303

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Compra en largo	Minería	Goldman Sachs	USD	83.341	(537)	24-may-2023	(537)
Compra en largo	Minería	J.P. Morgan	GBP	111.444	(16.135)	09-may-2023	(16.135)
Compra en largo	Minería	J.P. Morgan	NOK	43.112	813	09-may-2023	813
Compra en largo	Minería	Morgan Stanley	GBP	218.954	7.207	15-may-2023	7.207
Compra en largo	Minería	Morgan Stanley	USD	684.938	(68.200)	15-may-2023	(68.200)
Compra en largo	Fabricación diversa	Goldman Sachs	USD	321.791	(27.710)	25-may-2023	(27.710)
Compra en largo	Fabricación diversa	J.P. Morgan	SEK	467.063	(27.128)	09-may-2023	(27.128)
Compra en largo	Petróleo y gas	Goldman Sachs	EUR	510.694	188.042	16-dic-2022	188.042
Compra en largo	Petróleo y gas	Goldman Sachs	USD	424.648	43.099	24-may-2023	43.099
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	CAD	106.341	13.767	09-may-2023	13.767
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	EUR	310.460	4.059	09-may-2023	4.059
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	GBP	1.017.590	111.135	09-may-2023	111.135
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	JPY	6.377	239	09-may-2023	239
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	1.966.442	251.157	09-may-2023	251.157
Compra en largo	Petróleo y gas	Morgan Stanley	AUD	4.879	557	15-may-2023	557
Compra en largo	Petróleo y gas	Morgan Stanley	GBP	301.534	34.881	15-may-2023	34.881
Compra en largo	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	1.419.404	129.570	15-may-2023	129.570
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	CHF	1.229.505	(1.259)	24-may-2023	(1.259)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	EUR	477.567	9.487	24-may-2023	9.487
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	GBP	1.437.023	64.564	24-may-2023	64.564
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	JPY	2.887.369	(44.004)	24-may-2023	(44.004)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	1.843.330	(1.116)	24-may-2023	(1.116)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	CHF	12.473	(1.000)	09-may-2023	(1.000)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	EUR	14.791	(224)	22-ago-2022	(224)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	EUR	87.434	(9.493)	09-may-2023	(9.493)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	GBP	219.168	(12.178)	20-jul-2022	(12.178)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	GBP	10.442	(600)	09-may-2023	(600)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	HUF	317.458	(13.242)	09-may-2023	(13.242)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	USD	2.729.689	(230.147)	22-ago-2022	(230.147)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	USD	356.210	(33.202)	22-nov-2022	(33.202)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	USD	1.380.279	(46.274)	09-may-2023	(46.274)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	EUR	53.738	3.603	15-may-2023	3.603
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	GBP	324.902	12.606	15-may-2023	12.606
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	HKD	144.921	6.849	15-may-2023	6.849
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	JPY	439.485	(3.750)	15-may-2023	(3.750)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	1.626.296	(44.666)	15-may-2023	(44.666)
Compra en largo	Tuberías	Goldman Sachs	USD	183.138	17.831	24-may-2023	17.831
Compra en largo	Tuberías	J.P. Morgan	USD	1.958.931	19.863	09-may-2023	19.863
Compra en largo	Tuberías	Morgan Stanley	USD	995.725	(18.220)	15-may-2023	(18.220)
Compra en largo	Capital riesgo	Goldman Sachs	GBP	1.015.821	(13.073)	24-may-2023	(13.073)
Compra en largo	Capital riesgo	Goldman Sachs	USD	167.404	(5.864)	24-may-2023	(5.864)
Compra en largo	Capital riesgo	Morgan Stanley	GBP	68.042	(3.893)	15-may-2023	(3.893)
Compra en largo	Capital riesgo	Morgan Stanley	USD	247.348	(17.294)	15-may-2023	(17.294)
Compra en largo	Sector inmobiliario	Morgan Stanley	USD	2.893	(297)	15-may-2023	(297)
Compra en largo	REIT	J.P. Morgan	USD	293.748	(20.174)	09-may-2023	(20.174)
Compra en largo	Ventas minoristas	Goldman Sachs	USD	1.063.855	(54.740)	24-may-2023	(54.740)
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	699.444	(26.507)	15-may-2023	(26.507)
Compra en largo	Ahorros y préstamos	Morgan Stanley	USD	130.847	3.623	15-may-2023	3.623

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Compra en largo	Semiconductores	Goldman Sachs	EUR	70.031	(859)	24-may-2023	(859)
Compra en largo	Semiconductores	Goldman Sachs	USD	14.233	(136)	24-may-2023	(136)
Compra en largo	Semiconductores	J.P. Morgan	JPY	326.329	(17.251)	09-may-2023	(17.251)
Compra en largo	Semiconductores	J.P. Morgan	USD	369.605	7.520	09-may-2023	7.520
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	299.820	(8.478)	27-dic-2021	(8.478)
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	206.580	(8.044)	15-may-2023	(8.044)
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	USD	593.188	8.881	24-may-2023	8.881
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	USD	3.702	504	25-may-2023	504
Compra en largo	Software	J.P. Morgan	USD	254.078	(22.082)	22-ago-2022	(22.082)
Compra en largo	Software	J.P. Morgan	USD	398.622	(24.083)	09-may-2023	(24.083)
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	887.099	23.791	15-may-2023	23.791
Compra en largo	Telecomunicaciones	J.P. Morgan	USD	515.655	(24.183)	09-may-2023	(24.183)
Compra en largo	Transporte	Goldman Sachs	GBP	10.913	880	24-may-2023	880
Compra en largo	Transporte	Morgan Stanley	DKK	387.964	(23.504)	15-may-2023	(23.504)
Compra en largo	Transporte	Morgan Stanley	EUR	418.603	(12.505)	15-may-2023	(12.505)
Compra en largo	Varios*	Morgan Stanley	USD	22.214.733	(166.301)	27-mar-2023	(166.301)
Venta en corto	Líneas aéreas	Morgan Stanley	USD	44.245	(3.228)	15-may-2023	(3.228)
Venta en corto	Ropa	Morgan Stanley	EUR	141.122	3.389	03-dic-2021	3.389
Venta en corto	Ropa	Morgan Stanley	EUR	194.379	339	15-may-2023	339
Venta en corto	Ropa	Morgan Stanley	HKD	161.434	(11.638)	15-may-2023	(11.638)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	EUR	191.033	(6.315)	24-may-2023	(6.315)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	JPY	67.547	(695)	24-ago-2022	(695)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	JPY	67.290	(2.323)	24-may-2023	(2.323)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	USD	170.532	(2.379)	22-sep-2022	(2.379)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	USD	307.117	(17.713)	24-may-2023	(17.713)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	J.P. Morgan	EUR	160.344	4.625	09-may-2023	4.625
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	J.P. Morgan	HKD	52.907	6.012	20-sep-2023	6.012
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	J.P. Morgan	USD	390.784	(8.894)	09-may-2023	(8.894)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	USD	437.190	7.123	15-may-2023	7.123
Venta en corto	Piezas y equipamiento de automóviles	Goldman Sachs	EUR	73.579	(1.213)	22-sep-2022	(1.213)
Venta en corto	Piezas y equipamiento de automóviles	Goldman Sachs	USD	301.883	(4.857)	22-sep-2022	(4.857)
Venta en corto	Piezas y equipamiento de automóviles	J.P. Morgan	USD	29.927	4.435	09-may-2023	4.435
Venta en corto	Piezas y equipamiento de automóviles	Morgan Stanley	USD	61.338	2.662	15-may-2023	2.662
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	AUD	272.213	(7.537)	24-may-2023	(7.537)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	CHF	135.066	3.014	24-may-2023	3.014
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	DKK	472.811	(16.701)	24-may-2023	(16.701)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	EUR	2.881.864	(152.291)	24-may-2023	(152.291)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	HKD	655.553	(9.225)	24-may-2023	(9.225)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	JPY	550.725	3.213	24-may-2023	3.213
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	PLN	257.828	(4.018)	24-may-2023	(4.018)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	USD	9.091.768	(360.071)	24-may-2023	(360.071)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	CAD	328.205	(3.256)	21-dic-2022	(3.256)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	CZK	11.097	86	09-may-2023	86
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	DKK	20.365	291	09-may-2023	291
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	EUR	663.438	(24.805)	09-may-2023	(24.805)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	HKD	30.961	1.434	09-may-2023	1.434
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	JPY	143.876	1.289	09-may-2023	1.289
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	PLN	16.576	790	09-may-2023	790

* El contrato se mantiene en una cesta de varios valores estadounidenses.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	SEK	307.213	(10.365)	09-may-2023	(10.365)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	USD	1.762.076	(47.888)	09-may-2023	(47.888)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	AUD	59.245	(479)	15-may-2023	(479)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	CAD	653.891	16.780	15-may-2023	16.780
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	CHF	189.415	(299)	15-may-2023	(299)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	CZK	169.952	942	15-may-2023	942
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	EUR	1.426.061	(75.901)	15-may-2023	(75.901)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	GBP	123.778	(6.668)	15-may-2023	(6.668)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	HKD	450.637	14.011	15-may-2023	14.011
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	JPY	264.321	6.899	15-may-2023	6.899
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	PLN	607.709	5.511	15-may-2023	5.511
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	SEK	750.269	(24.505)	15-may-2023	(24.505)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	USD	2.770.921	32.910	15-may-2023	32.910
Venta en corto	Bebidas	J.P. Morgan	HKD	2.820	335	09-may-2023	335
Venta en corto	Bebidas	Morgan Stanley	HKD	354	-	15-may-2023	-
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	AUD	506.104	23.083	24-may-2023	23.083
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	CHF	37.272	(65)	24-may-2023	(65)
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	HKD	353.228	(851)	24-may-2023	(851)
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	1.290.285	(24.160)	24-may-2023	(24.160)
Venta en corto	Biotecnología	J.P. Morgan	AUD	132.347	5.253	22-jun-2022	5.253
Venta en corto	Biotecnología	J.P. Morgan	CHF	74.279	258	09-may-2023	258
Venta en corto	Biotecnología	J.P. Morgan	HKD	20.537	2.949	09-may-2023	2.949
Venta en corto	Biotecnología	J.P. Morgan	USD	2.916.667	288.612	09-may-2023	288.612
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	CHF	54.191	(1.119)	15-may-2023	(1.119)
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	HKD	71.799	4.741	15-may-2023	4.741
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	1.647.162	(110.180)	15-may-2023	(110.180)
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	CHF	148.767	844	22-sep-2022	844
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	CHF	159.334	10.417	24-may-2023	10.417
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	EUR	223.873	(2.207)	24-may-2023	(2.207)
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	SEK	97.421	6.417	24-may-2023	6.417
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	USD	147.990	3.282	22-sep-2022	3.282
Venta en corto	Materiales de construcción	J.P. Morgan	JPY	5.805	914	22-jun-2022	914
Venta en corto	Materiales de construcción	J.P. Morgan	SEK	12.649	1.105	05-may-2023	1.105
Venta en corto	Materiales de construcción	Morgan Stanley	CHF	32.541	2.123	15-may-2023	2.123
Venta en corto	Materiales de construcción	Morgan Stanley	EUR	21.936	1.490	15-may-2023	1.490
Venta en corto	Productos químicos	Goldman Sachs	USD	91.175	1.699	24-may-2023	1.699
Venta en corto	Productos químicos	J.P. Morgan	USD	93.887	1.474	09-may-2023	1.474
Venta en corto	Productos químicos	Morgan Stanley	EUR	70.757	(1.728)	15-may-2023	(1.728)
Venta en corto	Carbón	Goldman Sachs	HKD	41.475	(2.203)	24-may-2023	(2.203)
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	EUR	472.025	17.893	24-may-2023	17.893
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	GBP	173.579	10.082	22-sep-2022	10.082
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	329.016	11.767	22-sep-2022	11.767
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	1.082.923	12.947	24-may-2023	12.947
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	EUR	134.577	14.109	09-may-2023	14.109
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	GBP	16.818	476	05-may-2023	476
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	859.117	94.744	09-may-2023	94.744
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	15.901	810	22-may-2023	810
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	58.420	5.312	27-dic-2021	5.312

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	265.488	(261)	15-may-2023	(261)
Venta en corto	Informática	Morgan Stanley	USD	142.268	1.404	15-may-2023	1.404
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Goldman Sachs	GBP	147.664	(622)	22-sep-2022	(622)
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Goldman Sachs	JPY	152.399	629	24-ago-2022	629
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Goldman Sachs	JPY	4.314	(128)	24-may-2023	(128)
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Morgan Stanley	GBP	13.663	(121)	15-may-2023	(121)
Venta en corto	Distribución/venta mayorista	Goldman Sachs	GBP	81.983	1.447	24-may-2023	1.447
Venta en corto	Distribución/venta mayorista	Goldman Sachs	USD	386.105	2.496	22-sep-2022	2.496
Venta en corto	Distribución/venta mayorista	Goldman Sachs	USD	202.090	5.560	24-may-2023	5.560
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	CHF	1.027.625	(42.005)	24-may-2023	(42.005)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	EUR	1.558.029	(49.558)	24-may-2023	(49.558)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	GBP	1.838.907	(3.581)	24-may-2023	(3.581)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	3.825.645	(35.382)	24-may-2023	(35.382)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	CHF	44.049	618	09-may-2023	618
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	EUR	242.122	(798)	09-may-2023	(798)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	GBP	978.191	46.147	09-may-2023	46.147
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	USD	1.238.759	56.547	09-may-2023	56.547
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	EUR	124.767	(266)	15-may-2023	(266)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	GBP	555.502	30.591	15-may-2023	30.591
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	645.650	56.597	15-may-2023	56.597
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	ZAR	58.658	448	15-may-2023	448
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	CAD	505.698	16.681	22-sep-2022	16.681
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	DKK	111.744	4.228	24-may-2023	4.228
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	EUR	528.753	(2.086)	24-may-2023	(2.086)
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	HKD	3.152	(54)	24-may-2023	(54)
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	USD	1.197.472	33.334	22-sep-2022	33.334
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	HKD	47.334	2.961	05-may-2023	2.961
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	479.015	29.557	05-may-2023	29.557
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	223.569	10.389	09-may-2023	10.389
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	HKD	54.759	(573)	15-may-2023	(573)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	455.580	39.437	15-may-2023	39.437
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Goldman Sachs	EUR	231.275	3.303	22-sep-2022	3.303
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Goldman Sachs	EUR	108.968	133	24-may-2023	133
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Goldman Sachs	USD	20.696	266	24-may-2023	266
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	J.P. Morgan	USD	21.044	1.103	09-may-2023	1.103
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Morgan Stanley	HKD	42.858	3.547	15-may-2023	3.547
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Morgan Stanley	USD	21.082	472	15-may-2023	472
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	JPY	1.074.647	82.634	24-may-2023	82.634
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	SEK	104.211	2.791	22-sep-2022	2.791
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	USD	316.686	(777)	22-sep-2022	(777)
Venta en corto	Electrónica	J.P. Morgan	JPY	63.592	4.242	09-may-2023	4.242
Venta en corto	Electrónica	J.P. Morgan	USD	12.903	339	05-may-2023	339
Venta en corto	Electrónica	J.P. Morgan	USD	655.196	101.738	22-ago-2023	101.738
Venta en corto	Electrónica	Morgan Stanley	JPY	88.480	8.122	15-may-2023	8.122
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Goldman Sachs	USD	118.281	(5.774)	24-may-2023	(5.774)
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	SEK	108.378	14.027	09-may-2023	14.027
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	USD	114.901	(12.540)	09-may-2023	(12.540)
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	GBP	47.066	3.372	15-may-2023	3.372

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	SEK	2.805	55	15-may-2023	55
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	USD	70.306	(1.552)	15-may-2023	(1.552)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Goldman Sachs	CHF	5.631	(158)	24-may-2023	(158)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Goldman Sachs	EUR	6.244	(447)	24-may-2023	(447)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Goldman Sachs	NZD	3.814	(135)	24-may-2023	(135)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Goldman Sachs	USD	140.976	126	22-sep-2022	126
Venta en corto	Ingeniería y construcción	J.P. Morgan	EUR	4.394	(24)	22-ago-2022	(24)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Morgan Stanley	EUR	280.116	(3.764)	15-may-2023	(3.764)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Morgan Stanley	MXN	3.759	(264)	15-may-2023	(264)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Morgan Stanley	USD	90.731	(2.956)	15-may-2023	(2.956)
Venta en corto	Control medioambiental	Morgan Stanley	NOK	27.945	(265)	15-may-2023	(265)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	EUR	777.240	40.180	22-may-2023	40.180
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	EUR	791.739	(861)	24-may-2023	(861)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	2.228.880	47.868	24-may-2023	47.868
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	35.474	(1.273)	25-may-2023	(1.273)
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	HKD	20.306	799	10-may-2022	799
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	238.440	2.913	05-may-2023	4.574
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	5.495.877	(211.055)	09-may-2023	(203.601)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	790.173	24.801	15-may-2023	24.801
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	21.530.199	11.415	15-may-2023	14.899
Venta en corto	Índice de tipo fijo/variable	J.P. Morgan	USD	2.545.000	40.910	22-nov-2021	40.910
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	364.294	15.251	24-may-2023	15.251
Venta en corto	Alimentos	J.P. Morgan	EUR	214.621	15.577	09-may-2023	15.577
Venta en corto	Alimentos	Morgan Stanley	USD	145.494	7.287	15-may-2023	7.287
Venta en corto	Gas	Goldman Sachs	EUR	251.616	(3.125)	22-sep-2022	(3.125)
Venta en corto	Gas	Goldman Sachs	EUR	269.363	(5.012)	24-may-2023	(5.012)
Venta en corto	Gas	Goldman Sachs	USD	693.315	9.285	22-sep-2022	9.285
Venta en corto	Herramientas manuales/automáticas	Goldman Sachs	CHF	116.563	7.878	22-sep-2022	7.878
Venta en corto	Herramientas manuales/automáticas	Goldman Sachs	USD	170.743	8.055	24-may-2023	8.055
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	DKK	176.642	19.403	24-may-2023	19.403
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	SEK	472.532	20.974	24-may-2023	20.974
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	2.374.585	119.115	24-may-2023	119.115
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	DKK	307.299	20.842	09-may-2023	20.842
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	SEK	302.112	31.987	09-may-2023	31.987
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	650.311	19.394	09-may-2023	19.394
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	EUR	110.401	2.314	15-may-2023	2.314
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	HKD	275.807	2.169	15-may-2023	2.169
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	SEK	243.949	13.756	15-may-2023	13.756
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	977.495	16.269	15-may-2023	16.269
Venta en corto	Salud (servicios)	Goldman Sachs	JPY	162.453	9.692	24-may-2023	9.692
Venta en corto	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	1.201.482	29.752	24-may-2023	29.752
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	EUR	268.833	13.615	22-jun-2022	13.615
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	EUR	102.645	4.375	09-may-2023	4.375
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	JPY	86.729	2.855	09-may-2023	2.855
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	233.200	26.373	22-ago-2022	26.373
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	216.709	(7.687)	23-feb-2023	(7.687)
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	765.137	22.395	09-may-2023	22.395
Venta en corto	Salud (servicios)	Morgan Stanley	EUR	759.952	72.524	15-may-2023	72.524

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Venta en corto	Salud (servicios)	Morgan Stanley	JPY	172.876	10.959	15-may-2023	10.959
Venta en corto	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	449.636	25.525	15-may-2023	25.525
Venta en corto	Sociedades de control (varios)	Goldman Sachs	USD	129.810	(386)	24-may-2023	(386)
Venta en corto	Sociedades de control (varios)	J.P. Morgan	USD	310.420	25.116	09-may-2023	25.116
Venta en corto	Constructores de viviendas	Goldman Sachs	USD	54.880	(8.219)	24-may-2023	(8.219)
Venta en corto	Mobiliario del hogar	Goldman Sachs	USD	144.245	3.581	22-sep-2022	3.581
Venta en corto	Mobiliario del hogar	Morgan Stanley	USD	28.792	660	15-may-2023	660
Venta en corto	Productos/artículos para el hogar	Goldman Sachs	USD	35.991	486	24-may-2023	486
Venta en corto	Productos/artículos para el hogar	J.P. Morgan	USD	105.911	1.791	27-may-2022	1.791
Venta en corto	Productos/artículos para el hogar	Morgan Stanley	USD	1.087	14	15-may-2023	14
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	EUR	131.205	(6.983)	22-sep-2022	(6.983)
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	EUR	887.461	(31.166)	24-may-2023	(31.166)
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	HKD	413.722	(11.312)	24-may-2023	(11.312)
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	JPY	263.470	5.121	24-may-2023	5.121
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	USD	324.430	1.777	22-sep-2022	1.777
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	USD	1.584.022	(28.343)	24-may-2023	(28.343)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	EUR	175.394	(11.952)	09-may-2023	(11.952)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	GBP	834.255	52.859	09-may-2023	52.859
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	USD	104.693	(2.471)	05-may-2023	(2.471)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	USD	510.542	16.910	09-may-2023	16.910
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	ZAR	172.221	(20.625)	09-may-2023	(20.625)
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	EUR	242.464	(17.558)	15-may-2023	(17.558)
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	GBP	647.914	2.262	15-may-2023	2.262
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	HKD	4.444	(85)	15-may-2023	(85)
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	USD	2.133.674	12.602	15-may-2023	12.602
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	ZAR	58.846	(3.418)	15-may-2023	(3.418)
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	HKD	4.201	90	24-may-2023	90
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	JPY	56.290	303	24-may-2023	303
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	USD	218.542	(12.810)	24-may-2023	(12.810)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	GBP	72.588	2.626	15-may-2023	2.626
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	HKD	4.235	(33)	15-may-2023	(33)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	366.764	11.186	15-may-2023	11.186
Venta en corto	Sociedades de inversión	J.P. Morgan	SEK	293.683	16.337	09-may-2023	16.337
Venta en corto	Sociedades de inversión	Morgan Stanley	SEK	576.032	12.379	15-may-2023	12.379
Venta en corto	Hierro y acero	Goldman Sachs	USD	140.919	(1.359)	22-sep-2022	(1.359)
Venta en corto	Hierro y acero	J.P. Morgan	USD	102.712	6.220	05-may-2023	6.220
Venta en corto	Hierro y acero	Morgan Stanley	USD	83.114	17.311	15-may-2023	17.311
Venta en corto	Tiempo libre	Goldman Sachs	USD	201.599	1.706	24-may-2023	1.706
Venta en corto	Tiempo libre	J.P. Morgan	USD	388.043	37.927	24-oct-2022	37.927
Venta en corto	Tiempo libre	Morgan Stanley	USD	665.543	105.078	15-may-2023	105.078
Venta en corto	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	306.372	(5.981)	15-may-2023	(5.981)
Venta en corto	Maquinaria (construcción y minería)	Goldman Sachs	USD	86.632	(522)	24-may-2023	(522)
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Goldman Sachs	JPY	166.565	6.480	24-may-2023	6.480
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Goldman Sachs	SEK	422.244	24.297	24-may-2023	24.297
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	J.P. Morgan	JPY	113.097	9.143	09-may-2023	9.143
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Morgan Stanley	JPY	42.781	4.837	15-may-2023	4.837
Venta en corto	Medios de comunicación	Goldman Sachs	GBP	102.401	(3.229)	24-may-2023	(3.229)
Venta en corto	Medios de comunicación	Goldman Sachs	USD	133.356	5.973	22-sep-2022	5.973

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Venta en corto	Medios de comunicación	Goldman Sachs	USD	232.708	4.982	24-may-2023	4.982
Venta en corto	Metalurgia	Goldman Sachs	USD	132.240	(701)	22-sep-2022	(701)
Venta en corto	Metalurgia	Goldman Sachs	USD	79.166	(8.377)	24-may-2023	(8.377)
Venta en corto	Minería	J.P. Morgan	USD	103.687	7.333	05-may-2023	7.333
Venta en corto	Fabricación diversa	Goldman Sachs	EUR	74.292	7.511	22-sep-2022	7.511
Venta en corto	Fabricación diversa	Goldman Sachs	GBP	100.877	(4.404)	22-sep-2022	(4.404)
Venta en corto	Fabricación diversa	Goldman Sachs	USD	265.740	7.522	22-sep-2022	7.522
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	AUD	400.727	(66.218)	24-may-2023	(66.218)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	EUR	374.682	(49.967)	24-may-2023	(49.967)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	JPY	168.195	(18.502)	24-may-2023	(18.502)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	USD	119.621	(11.430)	22-sep-2022	(11.430)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	USD	906.423	(83.928)	24-may-2023	(83.928)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	CAD	1.019.557	(271.753)	09-may-2023	(271.753)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	EUR	178.282	(26.289)	09-may-2023	(26.289)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	GBP	126.618	849	09-may-2023	849
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	4.769.631	(681.224)	09-may-2023	(681.010)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	AUD	187.187	(27.470)	15-may-2023	(27.470)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	38.720	(3.714)	15-may-2023	(3.714)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	GBP	20.121	(123)	15-may-2023	(123)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	509.496	(22.308)	15-may-2023	(22.308)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Goldman Sachs	USD	64.452	(8.310)	24-may-2023	(8.310)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	534.784	(34.431)	09-may-2023	(34.431)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	164.865	251	15-may-2023	251
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	DKK	362.091	7.330	24-may-2023	7.330
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	EUR	693.333	(5.051)	24-may-2023	(5.051)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	JPY	826.588	408	24-may-2023	408
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	943.653	(6.649)	24-may-2023	(6.649)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	32.617	(1.584)	25-may-2023	(1.584)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	CHF	201.329	18.913	09-may-2023	18.913
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	GBP	338.850	4.579	09-may-2023	4.579
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	HKD	458.738	30.236	09-may-2023	30.236
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	JPY	360.808	(5.953)	09-may-2023	(5.953)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	USD	1.094.718	27.787	09-may-2023	27.787
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	CHF	145.400	(2.205)	15-may-2023	(2.205)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	DKK	284.916	6.612	15-may-2023	6.612
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	EUR	234.095	(3.435)	15-may-2023	(3.435)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	HKD	214.056	9.678	15-may-2023	9.678
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	JPY	1.005.963	43.514	15-may-2023	43.514
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	542.476	(12.111)	15-may-2023	(12.111)
Venta en corto	Tuberías	Goldman Sachs	USD	529.976	(35.217)	24-may-2023	(35.217)
Venta en corto	Tuberías	J.P. Morgan	USD	827.076	(9.538)	09-may-2023	(9.538)
Venta en corto	Tuberías	Morgan Stanley	USD	250.907	1.807	15-may-2023	1.807
Venta en corto	Capital riesgo	J.P. Morgan	USD	494.701	17.828	09-may-2023	17.828
Venta en corto	Sector inmobiliario	Goldman Sachs	HKD	16.049	(4.478)	24-may-2023	(4.478)
Venta en corto	Sector inmobiliario	J.P. Morgan	HKD	10.903	(50)	09-may-2023	(50)
Venta en corto	Sector inmobiliario	J.P. Morgan	USD	3.362	152	09-may-2023	152
Venta en corto	Sector inmobiliario	Morgan Stanley	AUD	3.648	(6)	03-mar-2022	(6)
Venta en corto	Sector inmobiliario	Morgan Stanley	EUR	234.789	5.990	15-may-2023	5.990

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Valor de mercado	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Venta en corto	Sector inmobiliario	Morgan Stanley	HKD	11.507	(848)	15-may-2023	(848)
Venta en corto	REIT	Goldman Sachs	EUR	26.855	297	24-may-2023	297
Venta en corto	REIT	Goldman Sachs	USD	484.391	15.243	22-sep-2022	15.243
Venta en corto	REIT	J.P. Morgan	USD	205.757	9.689	05-may-2023	9.689
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	523.004	32.390	15-may-2023	32.390
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	JPY	3.835	62	24-may-2023	62
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	USD	195.212	2.292	22-sep-2022	2.292
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	USD	526.714	38.917	24-may-2023	38.917
Venta en corto	Ventas minoristas	J.P. Morgan	USD	218.766	(1.667)	05-may-2023	(1.667)
Venta en corto	Ventas minoristas	J.P. Morgan	USD	1.267.181	84.335	09-may-2023	84.335
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	CHF	198.446	3.340	15-may-2023	3.340
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	JPY	594	11	15-may-2023	11
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	SEK	452.227	2.372	15-may-2023	2.372
Venta en corto	Ahorros y préstamos	Goldman Sachs	USD	589.830	(62.145)	24-may-2023	(62.145)
Venta en corto	Ahorros y préstamos	Morgan Stanley	USD	65.737	(5.913)	15-may-2023	(5.913)
Venta en corto	Semiconductores	Goldman Sachs	USD	107.682	4.106	22-sep-2022	4.106
Venta en corto	Semiconductores	J.P. Morgan	USD	33.768	1.718	05-may-2023	1.718
Venta en corto	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	32.255	2.304	15-may-2023	2.304
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	CHF	991.334	39.753	24-may-2023	39.753
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	GBP	85.366	545	24-may-2023	545
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	298.512	9.567	22-sep-2022	9.567
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	738.391	12.633	24-may-2023	12.633
Venta en corto	Software	J.P. Morgan	CHF	53.093	5.142	09-may-2023	5.142
Venta en corto	Software	J.P. Morgan	USD	485.493	13.132	09-may-2023	13.132
Venta en corto	Software	J.P. Morgan	USD	14.917	535	15-may-2023	535
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	AUD	3.631	(67)	15-may-2023	(67)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	CHF	393.157	25.009	15-may-2023	25.009
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	EUR	253.438	9.923	15-may-2023	9.923
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	187.257	3.006	27-dic-2021	3.006
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	1.564.157	70.153	15-may-2023	70.153
Venta en corto	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	USD	66.770	3.631	27-dic-2021	3.631
Venta en corto	Textiles	Goldman Sachs	USD	107.522	2.856	24-may-2023	2.856
Venta en corto	Transporte	Goldman Sachs	USD	194.650	(404)	22-sep-2022	(404)
Venta en corto	Transporte	Goldman Sachs	USD	199.930	7.288	24-may-2023	7.288
Venta en corto	Transporte	J.P. Morgan	DKK	36.742	3.430	09-may-2023	3.430
Venta en corto	Transporte	Morgan Stanley	HKD	8.582	1.416	15-may-2023	1.416
USD							(485.299)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos por diferencias

Los contratos por diferencias se valoran tomando como base el precio del valor subyacente convertido a la divisa base del contrato por diferencias, menos cualquier comisión financiera atribuible a cada contrato registrado por separado. Al suscribir un contrato por diferencias, es posible que el Fondo deba entregar en garantía una cantidad en efectivo y/u otros activos al agente de bolsa, que sea igual a cierto porcentaje del importe del contrato ("margen inicial"). Posteriormente, los pagos conocidos como "márgenes de variación" son realizados o recibidos de forma periódica por el Fondo, según las fluctuaciones del valor del título subyacente. Las ganancias o las pérdidas materializadas al cierre del contrato son iguales a la diferencia entre el valor del contrato por diferencias en el momento en que se abrió (incluidos los cambios financieros) y el valor en el momento en que se cerró. Los dividendos (netos de impuestos de retención) atribuibles a contratos por diferencias abiertos se consideran dividendos por cobrar al final del ejercicio. El resultado de estas revalorizaciones se muestra en el Balance en el epígrafe "Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos por diferencias".

A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos tenían establecidos contratos por diferencias sobre índices financieros y contratos de futuros:

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price	Credit Suisse	(27)	(19.724)	(875)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Banks Price	Credit Suisse	3.304	538.906	11.603
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Basic Resources Price	Credit Suisse	(174)	(110.386)	(1.729)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Chemicals Price	Credit Suisse	389	567.123	(27.709)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price	Credit Suisse	760	514.950	(36.296)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Financial Services Price	Credit Suisse	491	393.848	(24.240)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price	Credit Suisse	855	777.693	(5.571)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Health Care Price	Credit Suisse	520	598.951	(26.563)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price	Credit Suisse	469	403.815	(18.705)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Insurance Price	Credit Suisse	2.088	735.241	(12.145)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Media Price	Credit Suisse	1.097	440.606	(14.644)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price	Credit Suisse	2.790	898.342	71.071
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods	Credit Suisse	(56)	(64.170)	838
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Retail Price	Credit Suisse	(504)	(254.482)	4.523
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Technology Price	Credit Suisse	449	390.662	(27.752)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Telecommunications Price	Credit Suisse	1.312	349.574	(5.341)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Travel & Leisure	Credit Suisse	1.995	603.702	(6.736)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Utilities Price	Credit Suisse	317	131.945	(12.375)
CFD sobre el índice S&P 500 Consumer Discretionary Sector	Goldman Sachs	1.480	2.115.935	(56.118)
CFD sobre el índice S&P 500 Consumer Staples Sector	Goldman Sachs	2.596	1.855.055	(87.270)
CFD sobre el índice S&P 500 Energy Sector	Goldman Sachs	2.391	946.549	26.103
CFD sobre el índice S&P 500 Financials Sector	Goldman Sachs	2.121	1.324.772	(26.504)
CFD sobre el índice S&P 500 Health Care Sector	Goldman Sachs	661	980.915	(59.241)
CFD sobre el índice S&P 500 Industrials Sector	Goldman Sachs	(88)	(72.761)	(3.972)
CFD sobre el índice S&P 500 Information Technology Sector	Goldman Sachs	289	758.288	(46.895)
CFD sobre el índice S&P 500 Materials Sector	Goldman Sachs	(281)	(139.556)	(5.659)
CFD sobre el índice S&P 500 Utilities Sector	Goldman Sachs	3.080	999.712	(68.617)
			USD 15.665.505	(460.819)
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD sobre acciones australianas	Morgan Stanley	(72.343)	(81.589)	(81.589)
CFD sobre acciones británicas	Goldman Sachs	(1.165.611)	354.943	354.943
CFD sobre acciones británicas	Morgan Stanley	(2.069.000)	1.304.827	1.304.827
CFD sobre acciones francesas	Morgan Stanley	81.900	(371.886)	(371.886)
CFD sobre acciones alemanas	Morgan Stanley	322.102	(2.581.899)	(2.581.899)
CFD sobre acciones israelíes	Goldman Sachs	(76.098)	341.680	341.680
CFD sobre acciones japonesas	Goldman Sachs	(565.228)	(1.150.513)	(1.150.513)
CFD sobre acciones japonesas	Morgan Stanley	(28.224)	(158.352)	(158.352)
CFD sobre acciones noruegas	Morgan Stanley	667.800	(2.658.443)	(2.658.443)
CFD sobre acciones suizas	Goldman Sachs	(117.389)	1.165.673	1.165.673
CFD sobre acciones estadounidenses	Goldman Sachs	(1.470.624)	7.644.793	7.644.785
CFD sobre acciones estadounidenses	Morgan Stanley	(1.210.544)	9.501.630	9.504.129
			USD 13.310.864	13.313.355

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos por diferencias (continuación)

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Helix				
CFD sobre acciones argentinas	Goldman Sachs	529	(105.215)	(105.215)
CFD sobre acciones argentinas	J.P. Morgan	2.321	(258.230)	(258.230)
CFD sobre acciones australianas	Goldman Sachs	2.580.911	(325.049)	(325.049)
CFD sobre acciones australianas	J.P. Morgan	1.880.101	79.831	79.831
CFD sobre acciones austriacas	Goldman Sachs	74.840	(31.212)	(31.212)
CFD sobre acciones austriacas	J.P. Morgan	54.040	56.622	56.622
CFD sobre acciones belgas	Goldman Sachs	89.006	150.950	150.950
CFD sobre acciones belgas	J.P. Morgan	27.464	44.819	44.819
CFD sobre acciones brasileñas	Goldman Sachs	6.814	(1.741)	(1.741)
CFD sobre acciones británicas	Goldman Sachs	37.431.117	(2.351.621)	(1.316.996)
CFD sobre acciones británicas	J.P. Morgan	3.152.543	(546.632)	(546.632)
CFD sobre acciones canadienses	Goldman Sachs	57.630	(88.093)	(88.093)
CFD sobre acciones canadienses	J.P. Morgan	131.531	109.966	109.966
CFD sobre acciones chinas	Goldman Sachs	17.562.310	(3.026.160)	(3.025.792)
CFD sobre acciones chinas	J.P. Morgan	10.297.699	158.532	158.531
CFD sobre acciones danesas	Goldman Sachs	46.767	(82.196)	(82.196)
CFD sobre acciones danesas	J.P. Morgan	182.256	176.311	176.311
CFD sobre acciones neerlandesas	Goldman Sachs	1.203.099	(131.322)	(131.322)
CFD sobre acciones neerlandesas	J.P. Morgan	310.112	(1.083.250)	(1.083.250)
CFD sobre acciones finlandesas	Goldman Sachs	254.216	(241.861)	(241.861)
CFD sobre acciones finlandesas	J.P. Morgan	84.048	78.974	78.974
CFD sobre acciones francesas	Goldman Sachs	387.736	(764.437)	(764.434)
CFD sobre acciones francesas	J.P. Morgan	40.021	(149.689)	(149.689)
CFD sobre acciones alemanas	Goldman Sachs	289.386	(659.932)	(659.932)
CFD sobre acciones alemanas	J.P. Morgan	258.108	(634.052)	(634.052)
CFD sobre acciones hongkonesas	Goldman Sachs	6.646.889	(1.230.988)	(1.230.988)
CFD sobre acciones hongkonesas	J.P. Morgan	5.043.400	718.754	718.754
CFD sobre acciones indias	Goldman Sachs	140.261	(272.763)	(272.763)
CFD sobre acciones indias	J.P. Morgan	176.526	2.733	2.733
CFD sobre acciones irlandesas	Goldman Sachs	152.780	(291.209)	(291.209)
CFD sobre acciones irlandesas	J.P. Morgan	69.912	20.084	20.084
CFD sobre acciones israelíes	Goldman Sachs	1.159	(9.120)	(9.120)
CFD sobre acciones israelíes	J.P. Morgan	2.361	1.912	1.912
CFD sobre acciones italianas	Goldman Sachs	209.900	(42.111)	(42.111)
CFD sobre acciones japonesas	Goldman Sachs	3.635.700	(922.112)	(922.437)
CFD sobre acciones japonesas	J.P. Morgan	7.891.357	(3.395.066)	(3.394.400)
CFD sobre acciones jerseyesas	Goldman Sachs	4.727	(2.357)	(2.357)
CFD sobre acciones kuwaitíes	J.P. Morgan	(844.478)	34.310	34.310
CFD sobre acciones luxemburguesas	Goldman Sachs	(2.920)	50.278	50.278
CFD sobre acciones macaenses	Goldman Sachs	145.000	(163.552)	(163.552)
CFD sobre acciones neozelandesas	Goldman Sachs	131.396	(9.768)	(9.768)
CFD sobre acciones neozelandesas	J.P. Morgan	747.957	(66.394)	(66.394)
CFD sobre acciones noruegas	Goldman Sachs	222.656	2.974	2.974
CFD sobre acciones noruegas	J.P. Morgan	269.205	155.079	155.079
CFD sobre acciones filipinas	Goldman Sachs	(190.090)	1.609	1.609
CFD sobre acciones polacas	Goldman Sachs	(106.302)	134.744	134.744
CFD sobre acciones polacas	J.P. Morgan	(22.850)	(25.407)	(25.407)
CFD sobre acciones portuguesas	J.P. Morgan	75.372	4.278	4.278
CFD sobre acciones rusas	Goldman Sachs	3.618.567	182.850	182.850

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos por diferencias (continuación)

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Helix (continuación)				
CFD sobre acciones rusas	J.P. Morgan	12.065	(6.340)	(6.340)
CFD sobre acciones saudíes	Goldman Sachs	4.873	(78.586)	(78.586)
CFD sobre acciones saudíes	J.P. Morgan	117.024	825	825
CFD sobre acciones singapurenses	Goldman Sachs	2.982.239	(133.492)	(133.492)
CFD sobre acciones singapurenses	J.P. Morgan	2.083.600	54.872	54.872
CFD sobre acciones sudafricanas	Goldman Sachs	61.449	(275.641)	(275.641)
CFD sobre acciones españolas	Goldman Sachs	(217.579)	69.116	69.116
CFD sobre acciones españolas	J.P. Morgan	634.579	162.973	162.973
CFD sobre acciones suecas	Goldman Sachs	575.292	(924.211)	(924.211)
CFD sobre acciones suecas	J.P. Morgan	1.386.053	(839.507)	(839.516)
CFD sobre acciones suizas	Goldman Sachs	17.802	22.998	22.913
CFD sobre acciones suizas	J.P. Morgan	245.209	(677.149)	(677.149)
CFD sobre acciones taiwanesas	Goldman Sachs	33.170	(359.098)	(359.098)
CFD sobre acciones taiwanesas	J.P. Morgan	(1.869.512)	(156.498)	(156.498)
CFD sobre acciones turcas	Goldman Sachs	(6.101.920)	152.413	152.413
CFD sobre acciones emiratís	J.P. Morgan	58.786	(4.832)	(4.832)
CFD sobre acciones estadounidenses	Goldman Sachs	27.828.392	(2.564.426)	(2.568.548)
CFD sobre acciones estadounidenses	J.P. Morgan	1.155.443	(4.076.561)	(4.076.258)
CFD sobre el índice FTSE 250	Goldman Sachs	(589)	274.272	274.272
CFD sobre el índice MSCI AC Pacific ex Japan Growth	Goldman Sachs	(65.832)	3.677.420	3.677.420
CFD sobre el índice MSCI EM Europe 10/40	Goldman Sachs	(416)	(11.937)	(11.937)
			USD (20.439.318)	(19.407.895)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
CFD sobre acciones británicas	Bank of America	(257.934)	(1.351)	(1.351)
CFD sobre acciones británicas	Morgan Stanley	2.390.843	14.327	14.327
CFD sobre acciones chinas	Morgan Stanley	122.642	(17.170)	(17.170)
CFD sobre acciones estadounidenses	Morgan Stanley	(31.189)	(44.725)	(44.725)
CFD sobre el índice FTSE 250	Bank of America	(281)	104.091	153.149
CFD sobre el índice MSBEUK01	Morgan Stanley	(14.424)	(31.877)	(31.877)
			GBP 23.295	72.353

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Índice de incumplimiento crediticio

Un índice de incumplimiento crediticio permite transmitir el riesgo de incumplimiento. Esto permite al Fondo adquirir en la práctica un seguro para una obligación del índice de referencia que posee (cubrir la inversión) o comprar protección para una obligación del índice de referencia que no posee físicamente en previsión de que se produzca un deterioro de la calidad del crédito. Una de las partes, el comprador de protección, realiza pagos periódicos al vendedor de la protección, que a su vez debe realizar un pago al comprador si se produce un acontecimiento de crédito (una reducción de la calidad crediticia, que se definirá previamente en el acuerdo firmado por ambas partes). Si el acontecimiento de crédito no se produce, el comprador paga todas las primas fijadas y el swap se resuelve al vencimiento sin que se realicen nuevos pagos. Por lo tanto, el riesgo del comprador queda limitado al valor de las primas pagadas. Además, si se produce un acontecimiento de crédito y el Fondo no posee la obligación de referencia subyacente, se puede producir un riesgo de mercado, ya que el Fondo puede tardar un tiempo en obtener la obligación del índice de referencia y entregarla a la contraparte. Asimismo, si la contraparte se declara en suspensión de pagos, es posible que el Fondo no pueda recuperar todo el dinero que esta le adeude. En ocasiones, el mercado de índices de incumplimiento crediticio es menos líquido que los mercados de renta fija. La Sociedad reducirá este riesgo controlando de una forma adecuada el uso de este tipo de transacción.

Los índices de incumplimiento crediticio se valoraron a su valor intrínseco. El método de valoración empleado implica el uso del valor actual de la serie de tipos de interés y el valor actual del diferencial de crédito negociado en el mercado en la fecha de cierre. El resultado de estos reajustes, junto con todos los intereses por cobrar/pagar en relación con el índice de incumplimiento crediticio, se indica en el Balance, en el epígrafe "Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio".

A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos estaban comprometidos con acuerdos de índices de incumplimiento crediticio sobre índices financieros:

Posición de protección	Descripción	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Interés (pagado)/recibido en %	Fecha de vencimiento	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend							
Venta	CDX iTraxx Europe Crossover Series 36 20/12/2026	J.P. Morgan	EUR	29.000.000	5,00	20-dic-2026	4.007.587
Venta	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	J.P. Morgan	EUR	105.000.000	1,00	20-dic-2026	3.206.538
Venta	CDX North America High Yield Series 37 20/12/2026	J.P. Morgan	USD	41.000.000	5,00	20-dic-2026	3.744.111
Venta	CDX North America Investment Grade Series 37 20/12/2026	J.P. Morgan	USD	132.000.000	1,00	20-dic-2026	3.168.124
USD							14.126.360
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Venta	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 36 20/12/2026	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20-dic-2026	(7.550)
Venta	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	Citi Bank	EUR	6.000.000	1,00	20-dic-2026	1.003
Venta	CDX North America High Yield Series 37 20/12/2026	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20-dic-2026	(89.289)
Venta	CDX North America Investment Grade Series 37 20/12/2026	Citi Bank	USD	50.000.000	1,00	20-dic-2026	5.652
USD							(90.184)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Venta	CDX Emerging Markets Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	USD	3.440.000	1,00	20-dic-2026	14.261
Venta	CDX iTraxx Europe Crossover Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	5.335.000	5,00	20-dic-2026	(16.405)
Venta	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	5.709.000	1,00	20-jun-2026	(13.136)
Venta	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	9.370.000	1,00	20-dic-2026	(7.375)
Venta	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	5.875.000	1,00	20-dic-2026	1.920
Venta	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	3.050.000	1,00	20-dic-2026	(6.845)
Venta	CDX North America High Yield Series 32 20/06/2024	Morgan Stanley	USD	2.670.000	5,00	20-jun-2024	(7.666)
Venta	CDX North America High Yield Series 37 20/12/2026	Morgan Stanley	USD	8.465.000	5,00	20-dic-2026	40.765
Venta	CDX North America Investment Grade Series 37 20/12/2026	Morgan Stanley	USD	8.275.000	1,00	20-dic-2026	806
USD							6.325

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de incumplimiento crediticio

Los swaps de incumplimiento crediticio permiten transmitir el riesgo de incumplimiento. Esto permite al Fondo adquirir en la práctica un seguro para una obligación de referencia que posee (cubrir la inversión) o comprar protección para una obligación de referencia que no posee físicamente en previsión de que se produzca un deterioro de la calidad del crédito. Una de las partes, el comprador de protección, realiza pagos periódicos al vendedor de la protección, que a su vez debe realizar un pago al comprador si se produce un acontecimiento de crédito (una reducción de la calidad crediticia, que se definirá previamente en el acuerdo firmado por ambas partes). Si el acontecimiento de crédito no se produce, el comprador paga todas las primas fijadas y el swap se resuelve al vencimiento sin que se realicen nuevos pagos. Por lo tanto, el riesgo del comprador queda limitado al valor de las primas pagadas. Además, si se produce un acontecimiento de crédito y el subfondo no posee la obligación de referencia subyacente, se puede producir un riesgo de mercado, ya que el subfondo puede tardar un tiempo en obtener la obligación de referencia y entregarla a la contraparte. Asimismo, si la contraparte se declara en suspensión de pagos, es posible que el subfondo no pueda recuperar todo el dinero que esta le adeude. En ocasiones, el mercado de los swaps de incumplimiento crediticio es menos líquido que los mercados de renta fija. La Sociedad reducirá este riesgo controlando de una forma adecuada el uso de este tipo de transacción.

Los swaps de incumplimiento crediticio se valoraron a su valor intrínseco. El método de valoración empleado implica el uso del valor actual de la serie de tipos de interés y el valor actual del diferencial de crédito negociado en el mercado en la fecha de cierre. El resultado de estos reajustes, junto con todos los intereses por cobrar/pagar en relación con los swaps de incumplimiento crediticio, se indica en el Balance, en el epígrafe "Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio".

A 30 de septiembre de 2021, el siguiente Subfondo estaba comprometido con contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Posición de protección	País de riesgo	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Venta	Australia	Minería	Morgan Stanley	EUR	425.000	20-dic-2026	5.460
Venta	Austria	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	EUR	3.225.000	20-dic-2026	7.657
Venta	Brasil	Soberanía	Morgan Stanley	USD	369.000	20-dic-2025	6.409
Venta	Brasil	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.956.000	20-jun-2026	(10.862)
Venta	Brasil	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.630.000	20-dic-2026	10.798
Venta	Chile	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.773.000	20-dic-2026	7.482
Venta	China	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.295.000	20-jun-2026	(5.820)
Venta	China	Soberanía	Morgan Stanley	USD	455.000	20-dic-2026	2.444
Venta	Colombia	Soberanía	Morgan Stanley	USD	954.000	20-jun-2026	(9.676)
Venta	Colombia	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.455.000	20-dic-2026	15.438
Venta	Francia	Publicidad	Morgan Stanley	EUR	850.000	20-dic-2026	173
Venta	Francia	Piezas y equipamiento de automóviles	Morgan Stanley	EUR	500.000	20-dic-2026	2.604
Compra	Francia	Bancos	Barclays Bank	EUR	5.800.000	20-dic-2026	5.828
Compra	Francia	Servicios comerciales	J.P. Morgan	EUR	425.000	20-dic-2026	3.157
Venta	Francia	Eléctrico	Morgan Stanley	EUR	1.675.000	20-dic-2026	2.526
Venta	Francia	Ingeniería y construcción	Morgan Stanley	EUR	2.600.000	20-dic-2026	6.347
Venta	Francia	Alimentos	Morgan Stanley	EUR	950.000	20-dic-2026	(1.228)
Venta	Francia	Alojamiento	Morgan Stanley	EUR	1.225.000	20-dic-2026	(9.466)
Venta	Francia	Medios de comunicación	Morgan Stanley	EUR	2.400.000	20-dic-2026	5.429
Venta	Indonesia	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.140.000	20-dic-2025	9.680
Venta	Indonesia	Soberanía	Morgan Stanley	USD	183.000	20-jun-2026	94
Compra	Italia	Bancos	Barclays Bank	EUR	950.000	20-dic-2026	(3.003)
Compra	Luxemburgo	Productos químicos	J.P. Morgan	EUR	450.000	20-dic-2026	(11.394)
Venta	Luxemburgo	Hierro y acero	Morgan Stanley	EUR	675.000	20-dic-2026	9.047
Compra	Luxemburgo	Medios de comunicación	Barclays Bank	EUR	525.000	20-dic-2024	27.418
Venta	Malasia	Soberanía	Goldman Sachs	USD	1.007.000	20-jun-2026	(3.347)
Venta	Malasia	Soberanía	Citi Bank	USD	307.000	20-jun-2026	(188)
Venta	Malasia	Soberanía	Morgan Stanley	EUR	1.875.000	20-dic-2026	(7.535)
Venta	México	Soberanía	Morgan Stanley	USD	444.000	20-jun-2026	(1.166)
Venta	México	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.680.000	20-dic-2026	3.722
Venta	Países Bajos	Transporte	Morgan Stanley	EUR	950.000	20-dic-2026	340
Venta	Filipinas	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.555.000	20-dic-2025	(9.150)
Venta	Federación de Rusia	Soberanía	Morgan Stanley	USD	889.000	20-jun-2026	(4.897)
Venta	Federación de Rusia	Soberanía	Morgan Stanley	USD	575.000	20-dic-2026	382
Venta	Arabia Saudí	Soberanía	Morgan Stanley	USD	435.000	20-dic-2025	4.838
Venta	Sudáfrica	Minería	Morgan Stanley	EUR	500.000	20-dic-2026	8.735
Venta	Sudáfrica	Soberanía	Morgan Stanley	USD	875.000	20-dic-2026	(541)
Venta	Corea del Sur	Soberanía	Morgan Stanley	USD	2.855.000	20-dic-2024	13.974

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de incumplimiento crediticio (continuación)

Posición de protección	País de riesgo	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)							
Venta	Corea del Sur	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.735.000	20-dic-2026	(1.527)
Compra	España	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	EUR	875.000	20-dic-2026	46.357
Venta	Turquía	Soberanía	Morgan Stanley	USD	3.060.000	20-jun-2026	(19.978)
Venta	Turquía	Soberanía	Morgan Stanley	USD	1.845.000	20-dic-2026	28.147
Venta	Reino Unido	Publicidad	Morgan Stanley	EUR	950.000	20-dic-2026	(1.782)
Venta	Reino Unido	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	EUR	237.500	20-jun-2024	6.641
Venta	Reino Unido	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	EUR	410.000	20-dic-2025	(33.525)
Venta	Reino Unido	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	EUR	750.000	20-dic-2026	21.819
Venta	Reino Unido	Bancos	Morgan Stanley	EUR	3.350.000	20-dic-2026	10.829
Venta	Reino Unido	Servicios comerciales	Morgan Stanley	EUR	3.000.000	20-dic-2026	(39.367)
Venta	Reino Unido	Eléctrico	Morgan Stanley	EUR	800.000	20-dic-2026	(779)
Venta	Reino Unido	Alimentos	BNP Paribas	EUR	175.000	20-dic-2022	(853)
Venta	Reino Unido	Alimentos	Bank of America	EUR	150.000	20-dic-2022	(731)
Venta	Reino Unido	Alimentos	Morgan Stanley	EUR	2.612.500	20-dic-2026	15.794
Venta	Reino Unido	Servicios alimenticios	Morgan Stanley	EUR	925.000	20-dic-2026	(745)
Venta	Reino Unido	Medios de comunicación	Morgan Stanley	EUR	1.700.000	20-dic-2026	14.159
Venta	Reino Unido	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	EUR	925.000	20-dic-2026	(241)
Venta	Reino Unido	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	EUR	1.625.000	20-dic-2026	(497)
Venta	Estados Unidos	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	USD	825.000	20-jun-2026	(23.029)
Venta	Estados Unidos	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	EUR	1.075.000	20-dic-2026	12.243
Compra	Estados Unidos	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	500.000	20-dic-2024	(2.323)
Venta	Estados Unidos	Alimentos	Morgan Stanley	USD	910.000	20-jun-2025	(40.163)
Venta	Estados Unidos	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20-dic-2024	(54.030)
Compra	Estados Unidos	Sector inmobiliario	J.P. Morgan	USD	705.000	20-jun-2024	(74.107)
Venta	Estados Unidos	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	1.920.000	20-jun-2025	68.763
USD							12.784

Contratos de swaps de divisas cruzadas

Los swaps de divisas cruzadas se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. La plusvalía/(minusvalía) latente se muestra en el Balance en el epígrafe "Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de divisas cruzadas". Un swap de divisas cruzadas es un contrato por el cual dos partes se comprometen durante un año determinado a canjear pagos de intereses denominados en dos divisas diferentes.

A 30 de septiembre de 2021, el siguiente subfondo tenía establecido contratos de swaps de divisas cruzadas:

Contraparte	Divisa de pago	Nominal	Divisa de recepción	Nominal	Vencimiento	Tipo de pago	Tipo de recepción	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Bank of America	RUB	248.615.000	USD	3.391.746	15-dic-2023	6,48%	USD LIBOR a 3 meses	1.268
Bank of America	RUB	241.307.000	USD	3.292.046	16-mar-2024	6,35%	USD LIBOR a 3 meses	956
Bank of America	RUB	5.145.000	USD	70.239	21-jun-2026	4,80%	USD LIBOR a 3 meses	3.680
Bank of America	USD	653.287	MXN	13.020.000	03-dic-2031	USD LIBOR a 1 mes	MXN TIIE a 28 días	(1.306)
Barclays	RUB	524.543.000	USD	7.275.215	15-dic-2023	6,35%	USD LIBOR a 3 meses	139.115
Barclays	TRY	10.266.000	USD	1.222.143	20-dic-2026	16,50%	USD LIBOR a 3 meses	88.581
Citibank	CNH	3.806.000	USD	580.183	16-mar-2024	2,71%	USD LIBOR a 3 meses	(9.100)
Citibank	CNH	3.805.000	USD	580.030	16-mar-2024	2,74%	USD LIBOR a 3 meses	(9.413)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Contratos de swaps de divisas cruzadas (continuación)

Contraparte	Divisa de pago	Nominal	Divisa de recepción	Nominal	Vencimiento	Tipo de pago	Tipo de recepción	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)								
Goldman Sachs	RUB	368.390.000	USD	5.027.499	15-dic-2026	5,86%	USD LIBOR a 3 meses	67.922
Goldman Sachs	RUB	140.109.000	USD	1.943.259	15-dic-2026	5,94%	USD LIBOR a 3 meses	51.423
Goldman Sachs	TRY	32.261.000	USD	3.627.889	16-mar-2023	20,54%	USD LIBOR a 3 meses	(5.900)
J.P. Morgan	RUB	75.162.000	USD	1.071.218	21-dic-2025	4,09%	USD LIBOR a 3 meses	91.038
J.P. Morgan	RUB	74.938.000	USD	1.025.284	15-dic-2026	5,77%	USD LIBOR a 3 meses	20.608
J.P. Morgan	RUB	61.264.000	USD	848.649	20-dic-2026	5,68%	USD LIBOR a 3 meses	12.034
J.P. Morgan	RUB	347.879.000	USD	4.747.419	16-mar-2027	5,85%	USD LIBOR a 3 meses	47.560
J.P. Morgan	TRY	6.405.000	USD	755.663	15-dic-2023	18,93%	USD LIBOR a 3 meses	46.194
J.P. Morgan	TRY	11.358.000	USD	1.364.160	16-mar-2024	18,22%	USD LIBOR a 3 meses	113.605
J.P. Morgan	TRY	14.470.000	USD	1.655.322	16-mar-2024	19,01%	USD LIBOR a 3 meses	43.515
J.P. Morgan	TRY	15.255.000	USD	1.721.395	16-mar-2024	19,66%	USD LIBOR a 3 meses	6.164
J.P. Morgan	TRY	18.650.000	USD	2.112.357	16-mar-2024	19,99%	USD LIBOR a 3 meses	5.406
J.P. Morgan	TRY	10.547.000	USD	1.348.721	21-jun-2026	11,88%	USD LIBOR a 3 meses	280.433
J.P. Morgan	USD	15.444.720	GBP	10.944.000	15-dic-2026	USD LIBOR a 3 meses	GBP LIBOR a 3 meses	(757.408)
J.P. Morgan	USD	653.943	MXN	13.020.000	03-dic-2031	USD LIBOR a 1 mes	MXN TIIE a 28 días	(1.969)
Morgan Stanley	USD	3.742.297	AUD	4.882.000	15-dic-2026	USD LIBOR a 3 meses	AUD BBR a 6 meses	(199.723)
Morgan Stanley	USD	11.750.405	AUD	16.113.000	16-mar-2027	USD LIBOR a 3 meses	AUD BBR a 6 meses	(75.802)
Morgan Stanley	USD	3.611.626	CAD	4.380.000	15-dic-2026	USD LIBOR a 3 meses	CAD BA a 3 meses	(155.194)
Morgan Stanley	USD	11.762.517	CAD	14.859.000	16-mar-2027	USD LIBOR a 3 meses	CAD BA a 3 meses	(45.939)
Morgan Stanley	USD	3.832.667	NOK	32.199.000	15-dic-2026	USD LIBOR a 3 meses	NZD BBR a 3 meses	(150.907)
Morgan Stanley	USD	11.581.685	NOK	101.100.000	16-mar-2027	USD LIBOR a 3 meses	NZD BBR a 3 meses	(21.290)
Morgan Stanley	USD	3.694.502	NZD	5.161.000	15-dic-2026	USD LIBOR a 3 meses	NZD BBR a 3 meses	(131.557)
Morgan Stanley	USD	11.697.993	NZD	16.715.000	16-mar-2027	USD LIBOR a 3 meses	NZD BBR a 3 meses	(165.920)
Morgan Stanley	USD	3.202.741	SEK	26.736.000	15-dic-2026	USD LIBOR a 3 meses	SEK STIBOR a 3 meses	(150.326)
Morgan Stanley	USD	12.259.400	SEK	106.034.000	16-mar-2027	USD LIBOR a 3 meses	SEK STIBOR a 3 meses	(132.669)
USD								(994.921)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés

Con el propósito de ofrecer cobertura frente a las fluctuaciones de los tipos de interés, la Sociedad puede emplear swaps de tipos de interés siempre que:

- los compromisos derivados de ellos no superen el valor de los correspondientes activos que se pretende proteger; y
- el importe total de dichas transacciones no supere el nivel necesario para cubrir el riesgo de fluctuación del valor de los activos en cuestión.

Dichos contratos deben estar denominados en las divisas de denominación de los activos de dicho Fondo (o en divisas que probablemente vayan a fluctuar de manera similar) y deben cotizar en una bolsa o negociarse en un Mercado regulado.

Los swaps de tipos de interés se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo a su valor intrínseco. El método de valoración empleado implica el uso de un valor actual para cada serie de tipo de interés y de capital convertida a la divisa del Fondo en la fecha de cierre. El resultado de estos reajustes, junto con todos los intereses por cobrar/pagar en relación con los swaps de tipos de interés, se indica en el Balance, en el epígrafe "Plusvalía/ (minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de tipos de interés".

A 30 de septiembre de 2021, los siguientes subfondos formaban parte de acuerdos de swaps sobre tipos de interés:

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend					
Paga tipo fijo al -0,31%					
Recibe tipo variable CHF LIBOR a 6 meses	J.P. Morgan	2.000.000	CHF	15-dic-2026	(2.930)
Paga tipo fijo al 0,06%					
Recibe tipo variable CHF LIBOR a 6 meses	J.P. Morgan	1.000.000	CHF	15-dic-2031	2.494
Paga tipo fijo al 6,04%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J.P. Morgan	200.000.000	MXN	13-dic-2023	107.771
Paga tipo fijo al 7,11%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J.P. Morgan	50.000.000	MXN	03-dic-2031	73.769
Paga tipo fijo al 0,33%					
Recibe tipo variable JPY TONA a 1 día	J.P. Morgan	100.000.000	JPY	15-dic-2041	(2.388)
Paga tipo fijo al 5,12%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J.P. Morgan	100.000.000	ZAR	15-dic-2023	4.203
Paga tipo fijo al -0,40%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	J.P. Morgan	25.000.000	EUR	15-dic-2023	(2.761)
Paga tipo fijo al 0,17%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	50.000.000	SEK	15-dic-2023	(1.454)
Paga tipo fijo al 0,54%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	20.000.000	SEK	15-dic-2026	1.347
Paga tipo fijo al 0,90%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	10.000.000	SEK	15-dic-2031	2.813
Paga tipo fijo al 1,38%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	2.000.000	USD	15-dic-2028	(952)
Paga tipo fijo al 1,83%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	500.000	USD	15-dic-2046	963
Paga tipo fijo al 1,81%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	1.000.000	USD	15-dic-2041	669
Paga tipo fijo al 0,99%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	3.000.000	USD	15-dic-2025	(1.869)
Paga tipo fijo al 0,48%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	10.000.000	USD	15-dic-2023	(4.280)
Paga tipo fijo al 0,33%					
Recibe tipo variable JPY TONA a 12 meses	J.P. Morgan	200.000.000	JPY	15-dic-2041	(11.532)
Paga tipo fijo al 0,91%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	10.000.000	SEK	15-dic-2031	2.234
Paga tipo fijo al 6,80%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J.P. Morgan	60.606.060	MXN	09-dic-2026	47.958
Paga tipo fijo al 6,81%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J.P. Morgan	39.393.940	MXN	09-dic-2026	29.957

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)					
Recibe tipo fijo al 5,87%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J.P. Morgan	200.000.000	ZAR	15-dic-2026	(304.241)
Paga tipo fijo al 0,79%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	J.P. Morgan	10.000.000	NZD	15-dic-2023	104.010
Recibe tipo fijo al 0,18%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	52.539.660	USD	15-dic-2023	(289.323)
Recibe tipo fijo al 0,46%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	34.294.785	SEK	15-dic-2031	(176.775)
Paga tipo fijo al 1,11%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	34.294.785	SEK	15-dic-2031	(69.728)
Paga tipo fijo al 0,60%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	7.539.660	USD	15-dic-2023	(21.423)
Paga tipo fijo al 0,72%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	48.979.667	SEK	15-dic-2026	(46.255)
Recibe tipo fijo al 4,72%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J.P. Morgan	167.000.000	ZAR	15-dic-2023	(88.810)
Recibe tipo fijo al 0,18%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	48.979.667	SEK	15-dic-2026	(104.527)
Paga tipo fijo al 2,26%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	1.485.020	USD	15-dic-2046	(130.982)
Paga tipo fijo al 1,12%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	12.104.754	USD	15-dic-2025	(71.917)
Recibe tipo fijo al 1,50%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	1.485.020	USD	15-dic-2046	(103.876)
Recibe tipo fijo al 1,48%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	1.618.660	USD	15-dic-2041	(93.994)
Paga tipo fijo al 2,23%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	1.618.660	USD	15-dic-2041	(117.006)
Recibe tipo fijo al 0,19%					
Paga tipo variable JPY TONA a 12 meses	J.P. Morgan	200.000.000	JPY	15-dic-2041	(37.008)
Recibe tipo fijo al 0,19%					
Paga tipo variable JPY TONA a 12 meses	J.P. Morgan	600.000.000	JPY	15-dic-2041	(111.025)
Recibe tipo fijo al 0,94%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	3.696.261	USD	15-dic-2028	(109.390)
Recibe tipo fijo al 0,50%					
Paga tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	J.P. Morgan	40.000.000	EUR	15-dic-2023	(91.133)
Recibe tipo fijo al -0,50%					
Paga tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	J.P. Morgan	50.000.000	EUR	15-dic-2023	(113.918)
Paga tipo fijo al 1,63%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	3.696.261	USD	15-dic-2028	(64.252)
Recibe tipo fijo al 4,72%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J.P. Morgan	333.000.000	ZAR	15-dic-2023	(177.089)
Recibe tipo fijo al 1,73%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	J.P. Morgan	534.091	NZD	15-dic-2031	(18.875)
Paga tipo fijo al 2,26%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	J.P. Morgan	6.534.091	NZD	15-dic-2031	15.082

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)					
Paga tipo fijo al 1,64%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	J.P. Morgan	10.000.000	NZD	15-dic-2026	101.936
Recibe tipo fijo al -0,03%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	118.588.669	SEK	15-dic-2023	(51.620)
Paga tipo fijo al 0,27%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	68.588.669	SEK	15-dic-2023	(16.994)
Recibe tipo fijo al 0,61%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	15.104.754	USD	15-dic-2025	(212.999)
Paga tipo fijo al 0,99%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	3.000.000	USD	15-dic-2025	(2.937)
Paga tipo fijo al 1,86%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	500.000	USD	15-dic-2046	(2.534)
Paga tipo fijo al 1,41%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	2.000.000	USD	15-dic-2028	(4.817)
Recibe tipo fijo al -0,63%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J.P. Morgan	5.549.070	CHF	15-dic-2026	(94.946)
Recibe tipo fijo al -0,21%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J.P. Morgan	5.549.070	CHF	15-dic-2026	(36.320)
Recibe tipo fijo al 0,18%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J.P. Morgan	5.049.985	CHF	15-dic-2031	(62.089)
Recibe tipo fijo al -0,30%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J.P. Morgan	5.049.985	CHF	15-dic-2031	(210.260)
Recibe tipo fijo al 0,05%					
Paga tipo variable CHF LIBOR a 6 meses	J.P. Morgan	1.000.000	CHF	15-dic-2031	3.613
Recibe tipo fijo al 8,98%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	J.P. Morgan	45.399.335	BRL	02-ene-2024	202.505
Recibe tipo fijo al 6,79%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	J.P. Morgan	5.399.335	BRL	02-ene-2024	(63.378)
Recibe tipo fijo al 8,28%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	J.P. Morgan	88.357.360	BRL	02-ene-2023	214.206
Recibe tipo fijo al 6,33%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	J.P. Morgan	8.357.360	BRL	02-ene-2023	(47.917)
				USD	(2.260.994)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Paga tipo fijo al 7,10%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	2.097.453	BRL	04-ene-2027	53.392
Paga tipo fijo al 7,71%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	11.711.490	BRL	04-ene-2027	227.651
Recibe tipo fijo al 2,84%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	6.141.000	AUD	17-jun-2031	101.754
Recibe tipo fijo al 1,94%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Deutsche Bank	850.000	ILS	17-jun-2031	(436)
Paga tipo fijo al 8,01%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	8.960.782	BRL	04-ene-2027	147.031
Paga tipo fijo al 8,07%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	11.522.847	BRL	04-ene-2027	181.536

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 7,75%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	2.818.214	BRL	04-ene-2027	54.173
Paga tipo fijo al 7,74%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	J.P. Morgan	464.072	BRL	04-ene-2027	9.082
Recibe tipo fijo al 7,21%					
Paga tipo variable MXN TIE a 28 días	Morgan Stanley	13.215.040	MXN	16-sep-2026	(5.628)
Recibe tipo fijo al 3,31%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	176.933.000	HUF	16-sep-2031	(8.009)
Recibe tipo fijo al 3,25%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	304.018.000	HUF	16-sep-2031	(16.212)
Recibe tipo fijo al 6,74%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Citi Bank	3.727.995.000	COP	16-sep-2031	(27.240)
Recibe tipo fijo al 7,05%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Goldman Sachs	5.960.351.000	COP	16-sep-2031	(28.511)
Recibe tipo fijo al 5,83%					
Paga tipo variable MXN TIE a 28 días	Morgan Stanley	61.138.000	MXN	20-sep-2023	(30.502)
Recibe tipo fijo al 1,45%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	3.200.000	PLN	21-dic-2023	(3.135)
Recibe tipo fijo al 5,37%					
Paga tipo variable INR MIBOR a 1 día	Goldman Sachs	194.032.000	INR	15-dic-2026	15.631
Paga tipo fijo al 0,78%					
Recibe tipo variable GBP LIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.051.000	GBP	15-dic-2031	37.870
Paga tipo fijo al 1,06%					
Recibe tipo variable GBP LIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	3.425.000	GBP	16-dic-2031	87.769
Recibe tipo fijo al 0,34%					
Paga tipo variable GBP LIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.224.000	GBP	21-dic-2023	(12.089)
Paga tipo fijo al 0,50%					
Recibe tipo variable GBP LIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	4.673.000	GBP	15-dic-2026	75.293
Paga tipo fijo al 0,72%					
Recibe tipo variable GBP LIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.419.000	GBP	20-dic-2026	24.748
Paga tipo fijo al 0,22%					
Recibe tipo variable GBP LIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	11.414.000	GBP	15-dic-2023	72.891
Recibe tipo fijo al 1,22%					
Paga tipo variable NOK NIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	29.750.000	NOK	15-dic-2023	(14.451)
Paga tipo fijo al 0,44%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	113.833.000	SEK	15-dic-2026	103.848
Paga tipo fijo al 0,16%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	203.000	EUR	15-dic-2031	1.176
Paga tipo fijo al 4,78%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Citi Bank	4.509.385.000	COP	15-dic-2023	1.945
Recibe tipo fijo al 6,75%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Goldman Sachs	4.094.833.000	COP	16-dic-2031	(34.338)
Recibe tipo fijo al 5,37%					
Paga tipo variable INR MIBOR a 1 día	Bank of America	118.377.000	INR	15-dic-2026	9.398
Paga tipo fijo al 1,10%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	2.285.000	USD	15-dic-2031	77.396

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 0,69%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	10.870.000	USD	15-dic-2026	(192.434)
Paga tipo fijo al 0,23%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	13.465.000	USD	15-dic-2023	34.159
Paga tipo fijo al 1,80%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	3.550.000	PLN	15-dic-2031	39.954
Paga tipo fijo al 1,72%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	2.686.000	NZD	15-dic-2026	19.835
Paga tipo fijo al 1,77%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Bank of America	1.594.355.000	KRW	16-dic-2031	16.421
Paga tipo fijo al 1,70%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.481.000	NZD	15-dic-2026	12.002
Paga tipo fijo al 1,67%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Goldman Sachs	1.459.988.000	KRW	16-dic-2031	20.087
Paga tipo fijo al 6,11%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	46.670.000	ZAR	15-dic-2026	40.178
Recibe tipo fijo al 7,65%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	57.171.000	MXN	10-dic-2031	(31.646)
Recibe tipo fijo al 1,38%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	725.000	USD	15-dic-2051	(73.164)
Paga tipo fijo al 0,74%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	3.650.000	USD	15-dic-2026	50.814
Paga tipo fijo al 2,84%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	209.100.000	HUF	15-dic-2031	29.909
Paga tipo fijo al 2,52%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	947.875.000	HUF	15-dic-2023	12.393
Paga tipo fijo al 3,74%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Goldman Sachs	736.530.000	ZAR	28-dic-2028	(7.903)
Paga tipo fijo al 1,58%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Deutsche Bank	1.619.147.000	KRW	15-dic-2026	18.579
Paga tipo fijo al 5,28%					
Recibe tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	314.520.000	INR	15-dic-2026	(8.982)
Recibe tipo fijo al 5,48%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	J.P. Morgan	1.279.379.000	COP	16-mar-2027	(8.469)
Recibe tipo fijo al 6,09%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	2.414.564.000	COP	16-mar-2032	(29.681)
Recibe tipo fijo al 5,40%					
Paga tipo variable INR MIBOR a 1 día	Citi Bank	136.494.000	INR	16-mar-2027	2.099
Recibe tipo fijo al 1,73%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	4.663.000	ILS	16-dic-2031	(20.604)
Paga tipo fijo al 4,59%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.515.905.000	CLP	15-dic-2031	107.656
Recibe tipo fijo al 4,04%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	5.717.055.000	CLP	15-dic-2026	(265.646)
Paga tipo fijo al 3,44%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	7.288.630.000	CLP	15-dic-2023	141.014

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 0,53%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	24.810.000	ILS	15-mar-2024	(8.328)
Recibe tipo fijo al 4,46%					
Paga tipo variable INR MIBOR a 1 día	Bank of America	99.731.000	INR	15-dic-2023	3.385
Paga tipo fijo al 2,07%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.720.000	PLN	16-mar-2032	11.222
Paga tipo fijo al 2,53%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	429.027.000	HUF	15-dic-2023	5.476
Paga tipo fijo al 4,88%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	BNP Paribas	3.068.228.000	COP	15-dic-2023	(295)
Paga tipo fijo al 4,87%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Citi Bank	3.068.227.000	COP	15-dic-2023	(64)
Recibe tipo fijo al 0,13%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	24.385.000	USD	15-dic-2022	(27.078)
Paga tipo fijo al 0,28%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	18.405.000	USD	15-dic-2023	25.980
Recibe tipo fijo al 0,47%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	8.370.000	USD	15-dic-2024	(29.662)
Recibe tipo fijo al 6,45%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	72.926.000	MXN	13-mar-2024	(26.931)
Paga tipo fijo al 3,12%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Bank of America	12.429.000	MYR	20-mar-2027	11.920
Paga tipo fijo al 1,04%					
Recibe tipo variable SGD SOR a 6 meses	J.P. Morgan	1.664.000	SGD	16-mar-2027	25.341
Paga tipo fijo al 6,17%					
Recibe tipo variable INR MIBOR a 1 día	J.P. Morgan	292.457.000	INR	20-mar-2027	(16.164)
Paga tipo fijo al 4,87%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	72.424.000	ZAR	16-mar-2023	(133)
Paga tipo fijo al 0,03%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.345.000	EUR	20-mar-2027	(295)
Paga tipo fijo al 9,88%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	J.P. Morgan	11.040.111	BRL	02-ene-2024	(20.771)
Recibe tipo fijo al 3,31%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Credit Suisse	830.706.000	CLP	18-mar-2031	(95.241)
Paga tipo fijo al 0,78%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	25.123.000	SEK	17-dic-2030	40.751
Recibe tipo fijo al 0,45%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	2.933.000	NZD	21-dic-2025	(93.236)
Paga tipo fijo al 1,05%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Goldman Sachs	974.461.000	KRW	17-dic-2030	35.751
Recibe tipo fijo al 0,56%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	2.014.000	AUD	15-mar-2026	(30.947)
Recibe tipo fijo al 1,11%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Citi Bank	492.000	ILS	18-mar-2031	(5.827)
Paga tipo fijo al 0,55%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	1.749.000	SEK	18-mar-2031	6.600

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 0,60%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	1.510.000	SEK	18-mar-2031	5.298
Paga tipo fijo al 7,58%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	21.605.000	ZAR	08-nov-2031	5.496
Recibe tipo fijo al 1,32%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	1.609.000	AUD	18-mar-2031	(51.445)
Recibe tipo fijo al 1,57%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	969.000	AUD	18-mar-2031	(22.818)
Recibe tipo fijo al 1,48%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	2.214.000	AUD	18-mar-2031	(58.950)
Recibe tipo fijo al 3,79%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	4.348.000	CLP	18-mar-2031	(410)
Recibe tipo fijo al 3,71%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Citi Bank	6.005.000	CLP	18-mar-2031	(587)
Paga tipo fijo al 1,33%					
Recibe tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	9.082.000	NOK	21-jun-2026	18.215
Recibe tipo fijo al 2,13%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	377.000	AUD	17-jun-2031	(2.368)
Recibe tipo fijo al 2,39%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	1.230.000	AUD	17-jun-2031	2.665
Recibe tipo fijo al 2,39%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	1.995.000	AUD	17-jun-2031	3.867
Recibe tipo fijo al 2,39%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	2.640.000	AUD	17-jun-2031	5.504
Recibe tipo fijo al 1,80%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Citi Bank	1.229.000	ILS	17-jun-2031	(3.093)
Recibe tipo fijo al 1,95%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	6.125.000	ILS	17-jun-2031	(2.273)
Recibe tipo fijo al 2,06%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Citi Bank	2.351.000	ILS	17-jun-2031	2.911
Paga tipo fijo al 1,77%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	J.P. Morgan	718.932.000	KRW	17-jun-2031	7.097
Paga tipo fijo al 0,47%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	4.271.000	USD	21-sep-2023	61
Paga tipo fijo al 2,56%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	1.895.000	USD	16-sep-2031	20.219
Paga tipo fijo al 1,80%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	11.470.000	PLN	20-sep-2026	42.612
Recibe tipo fijo al 4,56%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Goldman Sachs	1.066.645.000	CLP	16-sep-2031	(64.393)
Paga tipo fijo al 2,72%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	12.528.000	AUD	16-sep-2031	(31.568)
Recibe tipo fijo al 4,75%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Citi Bank	1.248.581.000	CLP	16-sep-2031	(65.660)
Recibe tipo fijo al 3,20%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	337.022.000	HUF	16-sep-2031	(19.893)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 4,76%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	226.559.000	CLP	16-sep-2031	(11.834)
Recibe tipo fijo al 7,03%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	45.219.000	MXN	16-sep-2026	(28.688)
Paga tipo fijo al 1,43%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	4.229.269.000	KRW	21-sep-2023	11.940
Paga tipo fijo al 1,53%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	2.840.000	USD	20-sep-2026	(1.907)
Recibe tipo fijo al 1,44%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	13.997.000	PLN	21-sep-2023	(9.875)
Recibe tipo fijo al 4,95%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	280.811.000	CLP	16-sep-2031	(12.450)
Recibe tipo fijo al 3,16%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	338.958.000	HUF	16-sep-2031	(21.784)
Recibe tipo fijo al 2,19%					
Paga tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	10.095.000	NOK	16-sep-2031	6.194
Recibe tipo fijo al 3,25%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	4.563.950.000	CLP	15-sep-2026	(425.415)
Paga tipo fijo al 4,02%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	977.715.000	CLP	15-sep-2031	130.998
Paga tipo fijo al 2,46%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	6.624.665.000	CLP	15-sep-2023	283.020
Paga tipo fijo al 4,35%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	209.561.000	ZAR	15-dic-2022	16.498
Paga tipo fijo al 2,03%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	435.328.000	HUF	15-dic-2023	18.973
Paga tipo fijo al 1,74%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 3 meses	Morgan Stanley	3.747.088.000	HUF	15-dic-2022	86.467
Paga tipo fijo al 0,80%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	72.398.000	PLN	15-dic-2022	29.119
Paga tipo fijo al 0,34%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	13.419.000	ILS	15-dic-2023	3.262
Recibe tipo fijo al 1,77%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	73.833.000	CZK	15-dic-2023	(70.669)
Paga tipo fijo al 5,27%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	279.933.000	MXN	14-dic-2022	121.641
Recibe tipo fijo al 6,15%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	309.501.000	MXN	20-dic-2023	(131.065)
Recibe tipo fijo al 3,71%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.145.857.930	CLP	21-dic-2023	(16.917)
Paga tipo fijo al 7,52%					
Recibe tipo variable RUB MOSPRIME a 3 meses	Barclays Bank	90.648.000	RUB	15-dic-2031	18.599
Paga tipo fijo al 1,84%					
Recibe tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	41.295.000	NOK	15-dic-2031	48.947
Paga tipo fijo al 0,84%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	3.440.000	SEK	15-dic-2031	11.146

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 0,34%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	8.215.000	USD	15-dic-2023	(11.429)
Paga tipo fijo al 0,22%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	5.134.000	EUR	15-dic-2026	(105.072)
Recibe tipo fijo al 7,26%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	11.240.000	MXN	16-may-2041	(40.096)
Recibe tipo fijo al 2,88%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	Bank of America	82.672.000	CNY	15-sep-2026	226.908
Recibe tipo fijo al 2,86%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	J.P. Morgan	30.214.000	CNY	15-sep-2026	79.703
Recibe tipo fijo al 1,93%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.338.000	NZD	15-dic-2031	(30.925)
Paga tipo fijo al 0,97%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.723.000	NZD	21-dic-2023	9.864
Recibe tipo fijo al 1,72%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	4.793.000	AUD	15-dic-2031	(9.289)
Recibe tipo fijo al 1,47%					
Paga tipo variable CAD BA a 3 meses	Morgan Stanley	15.796.000	CAD	15-dic-2026	(119.189)
Recibe tipo fijo al 2,00%					
Paga tipo variable CAD BA a 3 meses	Morgan Stanley	185.000	CAD	15-dic-2031	(3.539)
Recibe tipo fijo al 1,88%					
Paga tipo variable CAD BA a 3 meses	Morgan Stanley	1.618.000	CAD	20-dic-2026	(5.878)
Recibe tipo fijo al 0,56%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	13.211.000	SEK	20-sep-2026	(9.947)
Paga tipo fijo al 5,75%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	14.452.120	MXN	12-jun-2024	15.690
Paga tipo fijo al 4,92%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	36.314.124	MXN	17-jun-2022	8.656
Paga tipo fijo al 5,94%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	28.577.000	MXN	14-jun-2024	24.501
Recibe tipo fijo al 7,58%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	10.023.000	ZAR	15-dic-2031	(5.924)
Recibe tipo fijo al 7,60%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	10.505.000	ZAR	15-dic-2031	(5.426)
Recibe tipo fijo al 7,60%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	17.303.000	ZAR	15-dic-2031	(8.815)
Recibe tipo fijo al 7,58%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	20.530.000	ZAR	15-dic-2031	(12.613)
Recibe tipo fijo al 1,66%					
Paga tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	41.171.000	NOK	15-dic-2026	(98.935)
Paga tipo fijo al 6,27%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	12.985.000	ZAR	15-dic-2026	5.269
Paga tipo fijo al 6,27%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	5.802.000	ZAR	15-dic-2026	2.436
Paga tipo fijo al 2,13%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	1.886.000	USD	16-dic-2031	(148)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 1,97%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	4.579.000	ILS	16-dic-2031	(5.167)
Paga tipo fijo al 2,25%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	539.663.000	HUF	15-dic-2023	16.296
Recibe tipo fijo al 3,05%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	40.074.000	HUF	16-dic-2031	(3.264)
Paga tipo fijo al 2,30%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	665.592.000	HUF	15-dic-2023	17.695
Recibe tipo fijo al 0,42%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	BNP Paribas	8.454.000	ILS	21-dic-2023	(3.598)
Recibe tipo fijo al 0,45%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	6.752.000	ILS	21-dic-2023	(2.296)
Recibe tipo fijo al 2,64%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	Citi Bank	11.056.000	CNY	15-dic-2023	10.666
Paga tipo fijo al 1,84%					
Recibe tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	43.163.000	NOK	20-dic-2026	18.343
Recibe tipo fijo al 2,85%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	Citi Bank	5.320.000	CNY	15-dic-2026	12.883
Paga tipo fijo al 5,59%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	57.258.000	MXN	28-jun-2022	1.097
Recibe tipo fijo al 6,10%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	25.882.500	MXN	27-jun-2023	(3.726)
Paga tipo fijo al 6,36%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	41.261.375	MXN	25-jun-2024	15.041
Paga tipo fijo al 1,37%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Bank of America	3.805.280.000	KRW	15-dic-2022	4.032
Paga tipo fijo al 7,14%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	23.483.515	MXN	09-dic-2026	1.916
Paga tipo fijo al 2,06%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	42.644.000	CZK	15-dic-2026	60.900
Recibe tipo fijo al 0,97%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	9.208.000	ILS	20-dic-2026	(24.290)
Paga tipo fijo al 2,18%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	51.095.000	CZK	20-dic-2026	29.576
Recibe tipo fijo al 7,67%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	41.856.287	MXN	10-dic-2031	(21.934)
Recibe tipo fijo al 3,07%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	494.594.000	HUF	16-dic-2031	(38.965)
Recibe tipo fijo al 6,24%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	57.039.000	MXN	05-jul-2023	(2.230)
Recibe tipo fijo al 2,66%					
Paga tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Goldman Sachs	2.855.000	MYR	15-dic-2026	(5.896)
Recibe tipo fijo al 0,41%					
Paga tipo variable AUD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	4.473.000	AUD	15-dic-2023	3.759
Recibe tipo fijo al 2,61%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	J.P. Morgan	44.938.000	CNY	15-dic-2023	39.153

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 6,51%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	7.278.000	ZAR	15-dic-2026	(1.857)
Paga tipo fijo al 6,48%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	13.954.000	ZAR	15-dic-2026	(2.583)
Recibe tipo fijo al 2,93%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	Citi Bank	40.605.000	CNY	20-dic-2026	48.014
Recibe tipo fijo al 0,61%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	1.514.000	ILS	15-dic-2026	(6.781)
Recibe tipo fijo al 2,61%					
Paga tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Bank of America	2.355.861	MYR	15-dic-2026	(6.187)
Recibe tipo fijo al 2,69%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	J.P. Morgan	9.176.000	CNY	15-dic-2026	11.641
Recibe tipo fijo al 7,58%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	16.820.000	MXN	10-dic-2031	(10.973)
Recibe tipo fijo al 0,41%					
Paga tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	3.654.000	EUR	16-dic-2031	(32.081)
Recibe tipo fijo al 1,71%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Bank of America	1.106.243.000	KRW	20-dic-2026	(8.083)
Paga tipo fijo al 1,77%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	50.396.000	CZK	15-dic-2026	103.252
Recibe tipo fijo al 7,51%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	41.676.000	MXN	10-dic-2031	(31.616)
Recibe tipo fijo al 7,49%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	27.423.100	MXN	10-dic-2031	(21.538)
Recibe tipo fijo al 5,06%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	11.033.000	ZAR	15-dic-2023	(1.354)
Recibe tipo fijo al 0,69%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	4.955.000	PLN	15-dic-2023	(18.252)
Recibe tipo fijo al 7,40%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	37.585.000	MXN	10-dic-2031	(34.570)
Recibe tipo fijo al 2,88%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	282.017.000	HUF	16-dic-2031	(29.096)
Recibe tipo fijo al 4,88%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	39.579.000	ZAR	15-dic-2023	(13.323)
Recibe tipo fijo al 4,89%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	92.350.000	ZAR	15-dic-2023	(29.945)
Recibe tipo fijo al 1,34%					
Paga tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	18.782.000	NOK	15-dic-2026	(40.887)
Recibe tipo fijo al 0,13%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	23.652.000	ILS	15-dic-2022	(5.569)
Paga tipo fijo al 5,55%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	57.269.000	MXN	26-jul-2022	3.631
Recibe tipo fijo al 6,00%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	63.407.500	MXN	25-jul-2023	(16.988)
Paga tipo fijo al 6,25%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	45.430.000	MXN	23-jul-2024	24.583

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 2,35%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.455.105.000	HUF	15-dic-2023	34.880
Recibe tipo fijo al 2,51%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.202.295.000	HUF	15-dic-2026	(101.931)
Paga tipo fijo al 2,67%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	320.655.000	HUF	15-dic-2031	61.790
Recibe tipo fijo al 2,57%					
Paga tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Bank of America	3.175.000	MYR	15-dic-2026	(9.687)
Recibe tipo fijo al 5,08%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	744.930.000	CLP	16-dic-2031	(28.754)
Paga tipo fijo al 2,57%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	455.313.000	HUF	15-dic-2026	34.682
Recibe tipo fijo al 7,35%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	11.400.000	MXN	05-jul-2041	(35.926)
Recibe tipo fijo al 1,51%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	9.325.000	PLN	15-dic-2026	(51.599)
Paga tipo fijo al 1,78%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.350.000	PLN	15-dic-2031	27.386
Recibe tipo fijo al 5,82%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	65.827.500	MXN	02-ago-2023	(28.223)
Recibe tipo fijo al 5,89%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	65.827.500	MXN	31-jul-2023	(24.067)
Paga tipo fijo al 6,36%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	18.910.000	MXN	29-jul-2026	26.107
Paga tipo fijo al 6,41%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	18.910.000	MXN	27-jul-2026	23.940
Paga tipo fijo al 2,61%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	256.687.000	HUF	15-dic-2026	17.919
Recibe tipo fijo al 0,56%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	J.P. Morgan	5.938.000	ILS	15-dic-2026	(30.925)
Paga tipo fijo al 1,03%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	35.365.000	PLN	15-dic-2023	70.977
Recibe tipo fijo al 7,67%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	39.147.182	MXN	10-dic-2031	(20.543)
Paga tipo fijo al 6,42%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	85.145.000	MXN	31-jul-2026	106.526
Recibe tipo fijo al 5,90%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	98.800.000	MXN	04-ago-2023	(36.339)
Paga tipo fijo al 6,43%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	28.400.000	MXN	31-jul-2026	35.243
Paga tipo fijo al 1,65%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	2.470.000	NZD	15-dic-2026	24.069
Paga tipo fijo al 1,69%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.610.000	NZD	15-dic-2026	13.616
Paga tipo fijo al 6,51%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	56.785.000	MXN	03-ago-2026	60.816

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 6,00%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	65.825.000	MXN	07-ago-2023	(18.537)
Paga tipo fijo al 1,58%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	4.443.000	PLN	15-dic-2026	20.926
Paga tipo fijo al 2,30%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	HSBC	39.360.800	MYR	15-dic-2023	(780)
Paga tipo fijo al 1,82%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.570.000	PLN	15-dic-2031	27.460
Paga tipo fijo al 1,72%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	2.685.000	NZD	15-dic-2026	20.492
Paga tipo fijo al 2,34%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	633.000	NZD	16-dic-2031	6.467
Paga tipo fijo al 1,82%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.500.000	NZD	15-dic-2026	6.348
Paga tipo fijo al 1,75%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.815.000	PLN	15-dic-2031	22.185
Recibe tipo fijo al 7,75%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	13.620.000	MXN	10-dic-2031	(5.703)
Paga tipo fijo al 1,88%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	1.147.000	AUD	16-dic-2031	17.944
Recibe tipo fijo al 7,68%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	13.117.000	MXN	10-dic-2031	(6.668)
Paga tipo fijo al 1,60%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Goldman Sachs	3.338.920.000	KRW	16-dic-2031	54.753
Paga tipo fijo al 1,62%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	J.P. Morgan	1.001.676.000	KRW	16-dic-2031	15.696
Recibe tipo fijo al 2,68%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	782.355.000	HUF	15-dic-2026	(46.418)
Paga tipo fijo al 0,84%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	2.245.000	AUD	15-dic-2026	20.009
Paga tipo fijo al 0,44%					
Recibe tipo variable SGD SOR a 6 meses	Citi Bank	4.270.000	SGD	15-dic-2023	14.596
Paga tipo fijo al 1,72%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Bank of America	3.666.650.000	KRW	16-dic-2031	44.507
Paga tipo fijo al 7,40%					
Recibe tipo variable RUB MOSPRIME a 3 meses	Goldman Sachs	608.444.000	RUB	16-mar-2024	64.183
Recibe tipo fijo al 2,76%					
Paga tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	7.588.000	MYR	16-mar-2027	(13.096)
Paga tipo fijo al 3,34%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	9.473.639.000	CLP	16-mar-2023	154.415
Paga tipo fijo al 0,30%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	BNP Paribas	6.520.000	ILS	16-mar-2024	6.565
Paga tipo fijo al 3,41%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Goldman Sachs	2.914.035.000	CLP	15-dic-2023	82.103
Paga tipo fijo al 3,44%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Citi Bank	2.872.405.000	CLP	15-dic-2023	79.239

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 4,03%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Goldman Sachs	2.268.985.000	CLP	15-dic-2026	(136.631)
Recibe tipo fijo al 4,03%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Citi Bank	2.270.605.000	CLP	15-dic-2026	(136.109)
Paga tipo fijo al 4,52%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Goldman Sachs	605.770.000	CLP	15-dic-2031	57.560
Paga tipo fijo al 4,52%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Citi Bank	627.405.000	CLP	15-dic-2031	59.766
Paga tipo fijo al -0,05%					
Recibe tipo variable JPY LIBOR a 12 meses	Morgan Stanley	322.879.000	JPY	21-mar-2027	14.138
Paga tipo fijo al 0,09%					
Recibe tipo variable JPY LIBOR a 12 meses	Morgan Stanley	69.211.000	JPY	17-mar-2032	4.604
Paga tipo fijo al 4,46%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Goldman Sachs	1.044.250.000	CLP	16-dic-2026	38.128
Paga tipo fijo al 4,45%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	477.003.000	CLP	15-dic-2026	17.710
Paga tipo fijo al 4,44%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Bank of America	1.057.142.000	CLP	15-dic-2026	39.711
Paga tipo fijo al 1,62%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	J.P. Morgan	1.889.318.000	KRW	15-dic-2026	18.637
Paga tipo fijo al 1,80%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.320.000	NZD	15-dic-2026	6.589
Paga tipo fijo al 4,45%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Goldman Sachs	1.102.258.000	CLP	15-dic-2026	40.654
Paga tipo fijo al 4,59%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Bank of America	1.091.283.000	CLP	15-dic-2026	31.821
Paga tipo fijo al 4,43%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	879.852.000	CLP	15-dic-2026	33.436
Paga tipo fijo al -0,47%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	5.750.000	EUR	15-dic-2023	7.777
Recibe tipo fijo al -0,28%					
Paga tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	8.535.000	EUR	15-dic-2026	(65.812)
Paga tipo fijo al 0,03%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	3.140.000	EUR	15-dic-2031	56.274
Paga tipo fijo al 2,48%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	3.748.880.000	HUF	15-dic-2023	57.419
Recibe tipo fijo al 2,75%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.309.195.000	HUF	15-dic-2026	(112.119)
Paga tipo fijo al 2,97%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	618.790.000	HUF	15-dic-2031	66.002
Recibe tipo fijo al 1,70%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	15.460.000	PLN	15-dic-2026	(51.623)
Paga tipo fijo al 1,93%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	14.685.000	PLN	15-dic-2031	120.592
Paga tipo fijo al 4,60%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Citi Bank	654.790.000	CLP	15-dic-2026	19.032

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 4,88%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	96.645.000	ZAR	15-dic-2023	32.282
Paga tipo fijo al 6,02%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	120.460.000	ZAR	15-dic-2026	133.559
Recibe tipo fijo al 7,31%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	39.920.000	ZAR	15-dic-2031	(73.839)
Recibe tipo fijo al 2,75%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.762.780.000	HUF	15-dic-2026	(134.970)
Paga tipo fijo al 2,98%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.509.495.000	HUF	15-dic-2031	157.419
Paga tipo fijo al 0,28%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Goldman Sachs	13.519.000	ILS	15-dic-2023	8.001
Recibe tipo fijo al 5,72%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	204.048.000	ZAR	15-mar-2024	(46.402)
Recibe tipo fijo al 7,57%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	31.779.000	ZAR	16-mar-2032	(45.447)
Recibe tipo fijo al 2,70%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 3 meses	Morgan Stanley	1.869.574.000	HUF	15-mar-2024	(19.598)
Paga tipo fijo al 4,49%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.648.265.000	CLP	15-dic-2026	57.661
Recibe tipo fijo al 0,44%					
Paga tipo variable AUD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	2.625.000	AUD	16-mar-2024	(1.549)
Paga tipo fijo al 1,00%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	2.892.000	AUD	16-mar-2027	19.383
Paga tipo fijo al 0,66%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	7.258.000	AUD	15-mar-2024	5.006
Recibe tipo fijo al 1,31%					
Paga tipo variable CAD BA a 3 meses	Morgan Stanley	6.149.000	CAD	15-mar-2024	(10.492)
Recibe tipo fijo al 1,03%					
Paga tipo variable CAD BA a 3 meses	Morgan Stanley	5.611.000	CAD	16-mar-2024	(16.484)
Recibe tipo fijo al 1,76%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	J.P. Morgan	5.275.235.000	KRW	15-dic-2031	(76.389)
Recibe tipo fijo al 1,65%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.222.000	NZD	16-mar-2024	(691)
Recibe tipo fijo al 9,33%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	28.850.000	ZAR	16-dic-2031	(13.407)
Paga tipo fijo al 2,01%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	215.000	PLN	15-dic-2031	1.391
Paga tipo fijo al 2,00%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	4.990.000	PLN	15-dic-2031	33.414
Recibe tipo fijo al 1,70%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	5.420.000	PLN	15-dic-2026	(17.772)
Recibe tipo fijo al 1,70%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	9.455.000	PLN	15-dic-2026	(31.003)
Paga tipo fijo al 2,55%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.286.889.000	HUF	15-dic-2023	14.743

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 4,76%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Goldman Sachs	2.068.081.000	CLP	15-dic-2026	41.847
Recibe tipo fijo al 1,73%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Goldman Sachs	10.265.119.000	KRW	15-dic-2026	(57.876)
Recibe tipo fijo al 1,03%					
Paga tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	15.912.000	USD	16-mar-2027	(134.890)
Paga tipo fijo al 1,41%					
Recibe tipo variable USD LIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	2.852.000	USD	16-mar-2032	49.533
Paga tipo fijo al 1,71%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Bank of America	753.325.000	KRW	15-dic-2026	4.611
Paga tipo fijo al 1,69%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	J.P. Morgan	1.674.050.000	KRW	15-dic-2026	11.864
Paga tipo fijo al 2,42%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.457.000	NZD	16-dic-2031	11.612
Paga tipo fijo al 0,42%					
Recibe tipo variable SGD SOR a 6 meses	Bank of America	6.794.900	SGD	15-dic-2023	25.320
Recibe tipo fijo al 7,79%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	14.134.000	MXN	10-dic-2031	(5.078)
Paga tipo fijo al 4,13%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.527.971.000	CLP	15-dic-2023	17.278
Paga tipo fijo al 4,10%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Bank of America	3.565.208.000	CLP	15-dic-2023	42.162
Recibe tipo fijo al 7,64%					
Paga tipo variable RUB MOSPRIME a 3 meses	Barclays Bank	764.265.000	RUB	15-dic-2023	(47.959)
Paga tipo fijo al 1,92%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.880.000	NZD	15-dic-2026	1.937
Paga tipo fijo al 9,47%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	20.675.000	ZAR	16-dic-2031	7.104
Paga tipo fijo al 9,57%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	13.507.000	ZAR	17-mar-2032	4.531
Paga tipo fijo al 1,96%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	2.329.000	NZD	16-mar-2027	4.742
Paga tipo fijo al 2,16%					
Recibe tipo variable CAD BA a 3 meses	Morgan Stanley	3.286.000	CAD	17-mar-2032	34.732
Recibe tipo fijo al 7,71%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	7.688.000	ZAR	16-mar-2032	(6.302)
Recibe tipo fijo al 7,71%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	10.432.000	ZAR	16-mar-2032	(8.479)
Paga tipo fijo al 2,71%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	563.366.000	HUF	16-mar-2024	6.357
Recibe tipo fijo al 3,29%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	252.269.000	HUF	16-mar-2032	(8.418)
Recibe tipo fijo al 2,49%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	Citi Bank	10.323.000	CNY	16-mar-2027	(2.872)
Recibe tipo fijo al 2,50%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	J.P. Morgan	4.971.000	CNY	16-mar-2027	(1.011)

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 7,77%					
Recibe tipo variable RUB MOSPRIME a 3 meses	J.P. Morgan	30.686.000	RUB	16-mar-2024	448
Paga tipo fijo al 2,54%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	8.207.000	PLN	17-mar-2032	11.097
Paga tipo fijo al 6,39%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	42.305.000	ZAR	15-dic-2026	3.542
Paga tipo fijo al 6,40%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	89.060.000	ZAR	15-dic-2026	2.967
Paga tipo fijo al 5,81%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	204.100.000	MXN	27-sep-2022	3.445
Recibe tipo fijo al 6,35%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	202.695.000	MXN	26-sep-2023	(7.240)
Paga tipo fijo al 6,68%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	69.100.000	MXN	24-sep-2024	3.952
Paga tipo fijo al 2,00%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Bank of America	1.169.972.000	KRW	16-mar-2032	(1.534)
Recibe tipo fijo al 7,49%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	17.685.000	MXN	17-sep-2031	2.834
Recibe tipo fijo al 3,04%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 3 meses	Morgan Stanley	2.461.673.000	HUF	15-mar-2024	8
Recibe tipo fijo al 7,44%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	17.650.000	MXN	17-sep-2031	(460)
Paga tipo fijo al 2,79%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	20.073.000	CZK	16-mar-2027	(911)
				USD	1.479.884

Garantía por cobrar por la contraparte

A 30 de septiembre de 2021, la exposición de la garantía por cobrar por la contraparte en relación con los acuerdos derivados era la siguiente:

Subfondos	Contraparte	Tipo de garantía	Divisa	Total Garantía recibida
Schroder GAIA BlueTrend				
	Credit Suisse	Efectivo	THB	3.320.778
	Credit Suisse	Efectivo	USD	4.589.058
	HSBC	Efectivo	USD	80.000
	J.P. Morgan	Efectivo	EUR	6.111.965
	J.P. Morgan	Efectivo	MXN	4.690.807
	J.P. Morgan	Efectivo	NZD	261.478
	J.P. Morgan	Efectivo	USD	9.725.754
			USD	21.980.515
Schroder GAIA Cat Bond				
	HSBC	Efectivo	USD	3.560.000
			USD	3.560.000
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
	HSBC	Efectivo	USD	240.000
			USD	240.000

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Garantía por cobrar por la contraparte (continuación)

Subfondos	Contraparte	Tipo de garantía	Divisa	Total Garantía recibida
Schroder GAIA Egerton Equity				
	Merrill Lynch	Efectivo	CAD	4
	Merrill Lynch	Efectivo	USD	126
	Morgan Stanley	Efectivo	CAD	3
	Morgan Stanley	Efectivo	EUR	13.403.885
	Morgan Stanley	Efectivo	SGD	7
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	49.601
			EUR	13.446.823
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Efectivo	EUR	3.542.572
	Goldman Sachs	Efectivo	GBP	4.425.530
	Goldman Sachs	Efectivo	HKD	967.140
	Goldman Sachs	Efectivo	USD	13.240.992
	HSBC	Efectivo	USD	740.000
	J.P. Morgan	Efectivo	CAD	12.563
	J.P. Morgan	Efectivo	EUR	5.872.752
	J.P. Morgan	Efectivo	GBP	56.851
	J.P. Morgan	Efectivo	HKD	2.559.053
	J.P. Morgan	Efectivo	JPY	221.602.195
	J.P. Morgan	Efectivo	USD	6.913.666
			USD	40.294.469
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Credit Suisse	Efectivo	USD	90.000
	Goldman Sachs	Efectivo	USD	3.390.000
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	3.920.000
			USD	7.400.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	Citi Bank	Efectivo	EUR	1.305.242
	Credit Suisse	Efectivo	EUR	4.016.853
	Credit Suisse	Efectivo	JPY	33.937.404
	Credit Suisse	Efectivo	PLN	271.582
	Credit Suisse	Efectivo	THB	824.118
	HSBC	Efectivo	USD	670.000
	Morgan Stanley	Efectivo	CAD	216.168
	Morgan Stanley	Efectivo	EUR	20.110.468
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	14.528.290
	Société Générale	Efectivo	AUD	6.955.491
	Société Générale	Efectivo	GBP	8.032.105
	Société Générale	Efectivo	SEK	7.985.976
	Société Générale	Efectivo	SGD	808.300
	Société Générale	Efectivo	TRY	3
	Société Générale	Efectivo	USD	1.452.057
			USD	64.036.852
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
	Morgan Stanley	Efectivo	GBP	88.607
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	10
			GBP	88.614
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Efectivo	USD	990.000
	BNP Paribas	Efectivo	USD	20.000
	Citi Bank	Efectivo	USD	260.000
	Goldman Sachs	Efectivo	USD	851.915

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Garantía por cobrar por la contraparte (continuación)

Subfondos	Contraparte	Tipo de garantía	Divisa	Total Garantía recibida
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)	HSBC	Efectivo	USD	146.210
	J.P. Morgan	Efectivo	USD	659.000
	Merrill Lynch	Efectivo	USD	530.000
	Morgan Stanley	Efectivo	AUD	85.717
	Morgan Stanley	Efectivo	CAD	13.787
	Morgan Stanley	Efectivo	EUR	971.746
	Morgan Stanley	Efectivo	GBP	6.167
	Morgan Stanley	Efectivo	HUF	4.093
	Morgan Stanley	Efectivo	MXN	989.110
	Morgan Stanley	Efectivo	SGD	1.380
	Morgan Stanley	Efectivo	THB	95.588
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	2.927.493
				USD

Información sobre los costes de transacción

Los costes de transacción son los impuestos y las comisiones de agentes relacionadas con la compra y la venta de valores mobiliarios. Los subfondos de renta fija generalmente muestran la cifra cero, dado que las comisiones de los agentes se incluyen en el diferencial, el cual se excluye del cálculo en virtud del Anexo I, Apéndice B, Capítulo V de la Directiva 2009/65/CE del Parlamento Europeo. La parte de los costes de transacción del coste de adquisición o del precio de venta de los activos relacionados y los costes de transacción del Depositario no se incluyen en esta tabla. Los costes de los productos estructurados se incluyen en el valor de mercado.

Los costes de transacción correspondientes al ejercicio analizado fueron los siguientes:

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

Dividendos

Durante el ejercicio analizado, se abonaron las distribuciones de dividendos de los siguientes subfondos:

Fecha de registro	Fecha sin dividendos	Fecha de pago	Subfondo	Dividendo bruto	Divisa	Dividendo por Participación
9-oct-2020	16-oct-2020	23-oct-2020	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	226,18	USD	1,020023
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	428,54	SGD	1,349634
13-nov-2020	20-nov-2020	27-nov-2020	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	901,52	USD	4,065662
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.710,72	SGD	5,387570
11-dic-2020	18-dic-2020	28-dic-2020	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	850,70	USD	3,836475
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	2.105,06	SGD	5,099957
			Schroder GAIA Cat Bond Clase IF Dist.	64.179,91	USD	11,740972
8-ene-2021	15-ene-2021	22-ene-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	599,65	USD	2,704293
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.484,78	SGD	3,596859
12-feb-2021	19-feb-2021	26-feb-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	728,12	USD	3,283666
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	2.366,42	SGD	4,387777

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Dividendos (continuación)

Fecha de registro	Fecha sin dividendos	Fecha de pago	Subfondo	Dividendo bruto	Divisa	Dividendo por Participación
12-mar-2021	19-mar-2021	26-mar-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	619,67	USD	2,794579
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.793,74	SGD	3,762040
			Schroder GAIA Cat Bond Clase IF Dist.	157.508,93	USD	11,870498
09-abr-2021	16-abr-2021	23-abr-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	616,45	USD	2,780058
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.762,59	SGD	3,696483
14-may-2021	21-may-2021	28-may-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	611,69	USD	2,758591
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.751,96	SGD	3,673943
11-jun-2021	18-jun-2021	25-jun-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	427,73	USD	2,646343
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.679,44	SGD	3,521644
			Schroder GAIA Cat Bond Clase IF Dist.	193.802,98	USD	11,173865
09-jul-2021	16-jul-2021	23-jul-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	443,52	USD	2,744035
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.792,73	SGD	3,759063
13-ago-2021	20-ago-2021	27-ago-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	610,74	USD	3,778620
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	2.401,98	SGD	5,036229
10-sep-2021	17-sep-2021	24-sep-2021	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	525,47	USD	3,251057
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	2.055,29	SGD	4,308963
			Schroder GAIA Cat Bond Clase IF Dist.	239.137,14	USD	13,125441
29-sep-2021	30-sep-2021	13-oct-2021	Schroder GAIA BlueTrend Clase C Dist. GBP Cubierta	209,14	GBP	1,128583
			Schroder GAIA BlueTrend Clase E Dist. GBP Cubierta	99.806,79	GBP	0,831679

Tipo de cambio

El tipo de cambio utilizado para el cálculo del total consolidado en EUR de los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 es:

1 euro = 1,15835 dólares estadounidenses

1 euro = 0,85969 libras esterlinas

Hechos posteriores

A 11 de noviembre de 2021, se lanzaron las siguientes clases de participaciones: Schroder GAIA Helix Clase A Acum. SEK Cubierta y Schroder GAIA Helix Clase C Acum. SEK Cubierta.

El 10 de diciembre de 2021, se lanzaron las siguientes clases de participaciones: Schroder GAIA Cat Bond Clase A Acum. EUR Cubierta.

El Depositario y Agente administrativo de la Sociedad, Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. ("BBH") ha celebrado un contrato con State Street Corporation ("State Street") en virtud del cual State Street adquirirá el negocio de servicios para inversores de BBH, que incluye sus servicios de custodia, contabilidad y administración de fondos, agencia de transferencia, depositario, cambio de divisas, fiduciario y préstamo de valores. La realización de la transacción está sujeta a las condiciones habituales de cierre y a las aprobaciones reglamentarias.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones

Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio	Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio
Schroder GAIA BlueTrend			Schroder GAIA Egerton Equity		
Clase A Acum.	9.048	0,50%	Clase A Acum.	922.896	0,89%
Clase A Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum. GBP Cubierta	29.494	1,01%
Clase A Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum. USD Cubierta	641.199	0,98%
Clase A Acum. SGD Cubierta	0	0,00%	Clase A Dist. GBP	2.064	0,89%
Clase C Acum.	223.082	0,83%	Clase A1 Acum.	39.404	0,81%
Clase C Acum. BRL Cubierta	85.788	0,66%	Clase A1 Acum. USD Cubierta	153.084	0,90%
Clase C Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum.	4.479.139	1,09%
Clase C Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. GBP Cubierta	882.515	1,35%
Clase C Acum. GBP Cubierta	89.513	0,22%	Clase C Acum. JPY Cubierta	92.274	1,01%
Clase C Dist. GBP Cubierta	68	0,26%	Clase C Acum. USD Cubierta	3.327.913	1,34%
Clase E Acum.	95.610	1,09%	Clase C Dist.	14.028	1,08%
Clase E Acum. CHF	31	1,65%	Clase C Dist. GBP	27.025	1,05%
Clase E Acum. CHF Cubierta	158	1,25%	Clase E Acum.	3.636	1,05%
Clase E Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase I Acum.	N/D#	N/D#
Clase E Acum. GBP	41	1,64%	Clase I Acum. USD Cubierta	N/D#	N/D#
Clase E Acum. GBP Cubierta	181	1,47%	Clase X Acum.	698.612	0,97%
Clase E Dist. GBP Cubierta	98.774	0,59%			
Clase I Acum.	N/D#	N/D#	Schroder GAIA Helix		
Clase N Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum.	15.175	1,58%
Clase N Acum. GBP Cubierta	967	0,56%	Clase A Acum. CHF Cubierta	633	1,46%
			Clase A Acum. EUR Cubierta	103.966	1,43%
			Clase A Acum. SGD Cubierta	236	2,00%
Schroder GAIA Contour Tech Equity			Clase C Acum.	50.071	3,18%
Clase A Acum.	469.240	1,58%	Clase C Acum. CHF Cubierta	241	1,98%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2.893	1,09%	Clase C Acum. EUR Cubierta	693.201	1,81%
Clase A Acum. EUR Cubierta	99.404	1,46%	Clase C Acum. GBP Cubierta	132.421	1,78%
Clase A Acum. SGD Cubierta	3.931	1,21%	Clase C Acum. SGD Cubierta	263	2,19%
Clase A1 Acum.	82.411	1,87%	Clase C1 Acum.	39	2,26%
Clase C Acum.	2.863.384	1,82%	Clase C1 Acum. CHF Cubierta	241	1,98%
Clase C Acum. CHF Cubierta	42.145	1,40%	Clase C1 Acum. EUR Cubierta	268	2,01%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1.912.123	1,59%	Clase E Acum.	785.055	1,69%
Clase C Acum. GBP Cubierta	704.583	2,19%	Clase E Acum. CHF Cubierta	25.278	1,29%
Clase C Acum. SEK Cubierta	193.583	1,77%	Clase E Acum. EUR Cubierta	803.345	1,38%
Clase C Acum. SGD Cubierta	265	1,89%	Clase E Acum. GBP Cubierta	135.259	1,45%
Clase E Acum.	74.081	2,15%	Clase E Acum. SGD Cubierta	207	1,70%
Clase E Acum. CHF Cubierta	7.904	1,82%	Clase I Acum.	N/D#	N/D#
Clase E Acum. EUR Cubierta	164.371	1,88%	Clase I Acum. JPY Cubierta	N/D#	N/D#
Clase E Acum. GBP Cubierta	157.783	2,12%	Clase X Acum. EUR Cubierta	2.029.436	2,24%
Clase E Acum. SEK Cubierta	128.768	1,93%			
Clase E Acum. SGD Cubierta	273	1,93%			
Clase I Acum.	N/D#	N/D#			

Comisión de rentabilidad no cobrada a la Clase de Participaciones.

Notas a los Estados financieros a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones (continuación)

Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio	Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio
Schroder GAIA M&A*			Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund		
Class A Acum.	0	0,00%	Clase C Acum.	12.739	2,58%
Class A Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. CHF Cubierta	3.535	2,73%
Class A Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. EUR Cubierta	350.155	2,29%
Class C Acum.	0	0,00%	Clase C Acum. USD Cubierta	67.647	3,92%
Class C Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase I Acum.	N/D#	N/D#
Class C Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase K Acum. EUR Cubierta	444	2,12%
Class C Acum. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase K Acum. USD Cubierta	286	3,51%
Class E Acum.	0	0,00%	Clase R Acum.	499.851	2,88%
Class E Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase R Acum. EUR Cubierta	69.252	2,26%
Class E Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase R Acum. USD Cubierta	31.650	3,50%
Class E Acum. GBP Cubierta	0	0,00%			
Class I Acum.	N/D#	N/D#	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Schroder GAIA Sirios US Equity			Clase A Acum.	190.323	1,26%
Clase A Acum.	420.658	0,33%	Clase A Acum. CHF Cubierta	1.053	0,50%
Clase A Acum. CHF Cubierta	35	0,00%	Clase A Acum. EUR Cubierta	98.771	0,77%
Clase A Acum. EUR Cubierta	4.629	0,01%	Clase A Acum. SGD Cubierta	20.046	1,07%
Clase C Acum.	1.019.391	0,64%	Clase A1 Acum.	15	0,96%
Clase C Acum. CHF Cubierta	3.850	0,13%	Clase C Acum.	4.318.376	1,98%
Clase C Acum. EUR Cubierta	173.308	0,25%	Clase C Acum. BRL Cubierta	203.185	1,34%
Clase C Acum. GBP Cubierta	57.163	0,44%	Clase C Acum. CHF Cubierta	73.294	0,46%
Clase C Dist. GBP Cubierta	2.763	0,42%	Clase C Acum. EUR Cubierta	1.297.867	1,44%
Clase E Acum.	2.850	0,86%	Clase C Acum. GBP Cubierta	809.331	1,60%
Clase E Acum. EUR Cubierta	16.931	0,37%	Clase C Acum. SGD Cubierta	175	1,61%
Clase I Acum.	N/D#	N/D#	Clase C1 Acum.	31	1,85%
Clase X Acum.	15	1,01%	Clase C1 Acum. CHF Cubierta	386	1,10%
Clase X Acum. EUR Cubierta	35.864	0,18%	Clase C1 Acum. EUR Cubierta	5.307	1,12%
Schroder GAIA Two Sigma Diversified			Clase E Acum.	94.489	1,58%
Clase C Acum.	0	0,00%	Clase E Acum. CHF Cubierta	58.144	1,14%
Clase C Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase E Acum. EUR Cubierta	261.489	1,24%
Clase C Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase E Acum. GBP Cubierta	136.324	1,50%
Clase C Acum. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase E Acum. SGD Cubierta	162	1,46%
Clase I Acum.	N/D#	N/D#	Clase I Acum.	N/D#	N/D#
Clase K Acum.	0	0,00%			
Clase K Acum. CHF Cubierta	0	0,00%			
Clase K Acum. EUR Cubierta	0	0,00%			

Para Schroder GAIA Cat Bond y Schroder GAIA Oaktree Credit*, no se cobra ninguna comisión de rentabilidad.

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.
Comisión de rentabilidad no cobrada a la Clase de Participaciones.

Ratio de gastos totales (“TER”) del ejercicio cerrado a 30 de septiembre de 2021

Subfondos y clases de participaciones	TER	Subfondos y clases de participaciones	TER
Schroder GAIA BlueTrend		Schroder GAIA Contour Tech Equity (continuación)	
Clase A Acum.	2,00%	Clase C Acum.	1,68%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2,03%	Clase C Acum. CHF Cubierta	1,71%
Clase A Acum. EUR Cubierta	2,03%	Clase C Acum. EUR Cubierta	1,71%
Clase A Acum. SGD Cubierta	2,03%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase C Acum.	1,40%	Clase C Acum. SEK Cubierta	1,71%
Clase C Acum. BRL Cubierta	1,43%	Clase C Acum. SGD Cubierta	1,71%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,43%	Clase E Acum.	1,43%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,43%	Clase E Acum. CHF Cubierta	1,46%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,43%	Clase E Acum. EUR Cubierta	1,46%
Clase C Dist. GBP Cubierta	1,43%	Clase E Acum. GBP Cubierta	1,46%
Clase E Acum.	1,40%	Clase E Acum. SEK Cubierta	1,46%
Clase E Acum. CHF	1,34%	Clase E Acum. SGD Cubierta	1,46%
Clase E Acum. CHF Cubierta	1,43%	Clase I Acum.	0,08%
Clase E Acum. EUR Cubierta	1,43%	Schroder GAIA Egerton Equity	
Clase E Acum. GBP	1,40%	Clase A Acum.	2,43%
Clase E Acum. GBP Cubierta	1,43%	Clase A Acum. GBP Cubierta	2,46%
Clase E Dist. GBP Cubierta	1,43%	Clase A Acum. USD Cubierta	2,46%
Clase I Acum.	0,07%	Clase A Dist. GBP	2,43%
Clase N Acum. EUR Cubierta	1,43%	Clase A1 Acum.	2,93%
Clase N Acum. GBP Cubierta	1,43%	Clase A1 Acum. USD Cubierta	2,96%
Schroder GAIA Cat Bond		Clase C Acum.	1,68%
Clase A Acum.	1,77%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase A Acum. SEK Cubierta	1,79%	Clase C Acum. JPY Cubierta	1,69%
Clase C Acum.	1,38%	Clase C Acum. USD Cubierta	1,71%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,40%	Clase C Dist.	1,68%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,41%	Clase C Dist. GBP	1,68%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,41%	Clase E Acum.	1,68%
Clase F Acum.	1,73%	Clase I Acum.	0,13%
Clase F Acum. CHF Cubierta	1,73%	Clase I Acum. USD Cubierta	0,16%
Clase F Acum. EUR Cubierta	1,73%	Clase X Acum.	1,57%
Clase F Dist.	1,73%	Schroder GAIA Helix	
Clase F Dist. SGD Cubierta	1,73%	Clase A Acum.	2,45%
Clase I Acum.	0,15%	Clase A Acum. CHF Cubierta	2,46%
Clase I Acum. CHF Cubierta	0,16%	Clase A Acum. EUR Cubierta	2,47%
Clase I Acum. EUR Cubierta	0,18%	Clase A Acum. SGD Cubierta	2,46%
Clase I Acum. JPY Cubierta	0,18%	Clase C Acum.	1,39%
Clase IF Acum.	1,32%	Clase C Acum. CHF Cubierta	1,41%
Clase IF Acum. CHF Cubierta	1,33%	Clase C Acum. EUR Cubierta	1,42%
Clase IF Acum. EUR Cubierta	1,33%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,44%
Clase IF Acum. SEK Cubierta	1,33%	Clase C Acum. SGD Cubierta	1,42%
Clase IF Dist.	1,32%	Clase C1 Acum.	1,36%
Schroder GAIA Contour Tech Equity		Clase C1 Acum. CHF Cubierta	1,41%
Clase A Acum.	2,43%	Clase C1 Acum. EUR Cubierta	1,40%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2,47%	Clase E Acum.	1,00%
Clase A Acum. EUR Cubierta	2,46%	Clase E Acum. CHF Cubierta	1,00%
Clase A Acum. SGD Cubierta	2,46%	Clase E Acum. EUR Cubierta	1,00%
Clase A1 Acum.	2,93%	Clase E Acum. GBP Cubierta	1,00%
		Clase E Acum. SGD Cubierta	0,99%

Tenga en cuenta que los costes de transacciones, según se detalla en las notas a los estados financieros y las comisiones de las transacciones relacionadas con la cartera subyacente de productos estructurados, no se incluyen en el TER anterior.

Ratio de gastos totales (“TER”) del ejercicio cerrado a 30 de septiembre de 2021 (continuación)

Subfondos y clases de participaciones	TER
Schroder GAIA Helix (continuación)	
Clase I Acum.	0,15%
Clase I Acum. JPY Cubierta	0,17%
Clase X Acum. EUR Cubierta	0,78%
Schroder GAIA M&A*	
Clase A Acum.	1,63%
Clase A Acum. CHF Cubierta	1,75%
Clase A Acum. EUR Cubierta	1,74%
Clase C Acum.	0,90%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,01%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,01%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,01%
Clase E Acum.	0,65%
Clase E Acum. CHF Cubierta	0,77%
Clase E Acum. EUR Cubierta	0,76%
Clase E Acum. GBP Cubierta	0,77%
Clase I Acum.	0,15%
Schroder GAIA Oaktree Credit*	
Clase A2 Acum.	1,40%
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	1,61%
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	1,59%
Clase C Acum.	0,91%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,11%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,09%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,10%
Clase E Acum.	0,93%
Clase E Acum. CHF Cubierta	0,96%
Clase E Acum. EUR Cubierta	0,96%
Clase E Acum. GBP Cubierta	0,95%
Clase I Acum.	0,15%
Schroder GAIA Sirios US Equity	
Clase A Acum.	2,43%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2,46%
Clase A Acum. EUR Cubierta	2,46%
Clase C Acum.	1,67%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,71%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,71%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase C Dist. GBP Cubierta	1,71%
Clase E Acum.	1,37%
Clase E Acum. EUR Cubierta	1,41%
Clase I Acum.	0,16%
Clase X Acum.	1,50%
Clase X Acum. EUR Cubierta	1,60%

Subfondos y clases de participaciones	TER
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Clase C Acum.	1,83%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,86%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,86%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,86%
Clase I Acum.	0,08%
Clase K Acum.	2,33%
Clase K Acum. CHF Cubierta	2,36%
Clase K Acum. EUR Cubierta	2,36%
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	
Clase C Acum.	1,16%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,18%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,18%
Clase C Acum. USD Cubierta	1,19%
Clase I Acum.	0,08%
Clase K Acum. EUR Cubierta	1,69%
Clase K Acum. USD Cubierta	1,71%
Clase R Acum.	1,21%
Clase R Acum. EUR Cubierta	1,22%
Clase R Acum. USD Cubierta	1,23%
Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Clase A Acum.	2,43%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2,46%
Clase A Acum. EUR Cubierta	2,46%
Clase A Acum. SGD Cubierta	2,46%
Clase A1 Acum.	2,86%
Clase C Acum.	1,68%
Clase C Acum. BRL Cubierta	1,71%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,67%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,70%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase C Acum. SGD Cubierta	1,72%
Clase C1 Acum.	1,66%
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	1,71%
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	1,74%
Clase E Acum.	1,18%
Clase E Acum. CHF Cubierta	1,21%
Clase E Acum. EUR Cubierta	1,21%
Clase E Acum. GBP Cubierta	1,21%
Clase E Acum. SGD Cubierta	1,22%
Clase I Acum.	0,09%

Tenga en cuenta que los costes de transacciones, según se detalla en las notas a los estados financieros y las comisiones de las transacciones relacionadas con la cartera subyacente de productos estructurados, no se incluyen en el TER anterior.

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Anexo I - Información sobre OICVM (sin auditar)

Perfil de riesgo y apalancamiento

1. Enfoque de compromisos

El enfoque empleado por los fondos con bajo uso de derivados o fondos que limitan su compromiso con derivados al 100% o menos de su Valor liquidativo.

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

2. Enfoque de VaR absoluto

El enfoque empleado para los fondos gestionados con el objetivo de obtener una rentabilidad absoluta, un límite de volatilidad absoluta o un rendimiento superior a un índice de referencia de tipos de interés.

Subfondos
Schroder GAIA BlueTrend
Schroder GAIA Contour Tech Equity
Schroder GAIA Egerton Equity
Schroder GAIA Helix
Schroder GAIA Two Sigma Diversified
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Subfondos	Utilización del límite del VaR regulador			Apalancamiento medio
	Inferior	Superior	Media	
Schroder GAIA BlueTrend	24,70%	73,16%	45,95%	1894,90%
Schroder GAIA Contour Tech Equity	39,53%	89,27%	55,79%	177,10%
Schroder GAIA Egerton Equity	35,27%	70,97%	47,35%	147,00%
Schroder GAIA Helix	9,65%	19,84%	13,87%	597,80%
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	23,54%	49,80%	33,05%	517,50%
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	15,10%	37,20%	22,33%	113,80%
Schroder GAIA Wellington Pagosa	7,69%	23,75%	15,20%	798,00%

Información sobre el modelo de VaR

Subfondos	Tipo de modelo	Intervalo de confianza	Periodo de tenencia	Periodo de observación
Schroder GAIA BlueTrend	Método de MonteCarlo	99%	20 días	1 año
Schroder GAIA Contour Tech Equity**	Método de MonteCarlo	99%	20 días	3 años
Schroder GAIA Egerton Equity**	Método de MonteCarlo	99%	20 días	3 años
Schroder GAIA Helix	Simulación paramétrica	99%	20 días	1 año
Schroder GAIA Two Sigma Diversified**	Método de MonteCarlo	99%	20 días	3 años
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund**	Método de MonteCarlo	99%	20 días	3 años
Schroder GAIA Wellington Pagosa**	Método de MonteCarlo	99%	20 días	3 años

* Para obtener más información sobre todas las actuaciones corporativas llevadas a cabo durante el ejercicio analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

** El periodo de observación se actualizó a 3 años a partir del 1 de julio de 2021.

Anexo I - Información sobre OICVM (sin auditar) (continuación)

Disposiciones sobre la remuneración de los OICVM de Schroder Investment Management Europe S.A. ("SIM Europe") para el ejercicio cerrado a 31 de diciembre de 2020

Dichas disposiciones forman parte de la sección sin auditar de este informe y cuentas anuales y deben leerse junto con el Informe de remuneración de Schroders plc de la página 75 a la 102 del Informe y cuentas anuales de 2020 (disponible en el sitio web del Grupo, <https://www.schroders.com/en/investor-relations/results-and-reports/annual-report-and-accounts-2020/>), que ofrece más información sobre las actividades de nuestro Comité de remuneración y nuestros principios y políticas de remuneración.

Los OICVM que asumen riesgos importantes ("OICVM MRT") de SIM Europe son individuos cuyas funciones en el Grupo Schroders pueden tener un impacto importante en el riesgo de SIM Europe o cualquier fondo OICVM que gestione. Estas funciones se identifican con arreglo a los requisitos de la Directiva sobre OICVM y a las directrices que establece la Autoridad Europea de Valores y Mercados.

El Comité de remuneración de Schroders plc ha establecido una política de remuneración para garantizar que todos los OICVM MRT cumplen los requisitos de la Directiva sobre OICVM. El Comité de remuneración y el Consejo de Schroders plc revisan la estrategia de remuneración al menos una vez al año. Los consejeros de SIM Europe se encargan de adoptar la política de remuneración, revisar sus principios generales al menos una vez al año, supervisar su aplicación y garantizar que se cumplen la legislación y los reglamentos locales correspondientes. Durante 2020 se revisó la Política de remuneración para garantizar el cumplimiento de los requisitos de remuneración de los OICVM/GFIAD y no se realizaron cambios significativos.

La aplicación de la política de remuneración está sujeta, al menos una vez al año, a revisión interna independiente para determinar si cumple las políticas y los procedimientos de remuneración adoptados por el Consejo de SIM Europe y el Comité de remuneración. En la revisión más reciente, no se detectaron problemas fundamentales, pero se llegó a una serie de recomendaciones menores, principalmente mejoras en la documentación de procesos y políticas.

La inversión total en la remuneración se determina en función de un coeficiente de participación en ganancias, que calcula el importe de remuneración variable en comparación con las ganancias previas a la bonificación, y a partir de un coeficiente de compensación total, que calcula los gastos de remuneración totales en comparación con las ganancias netas. Esto garantiza que los intereses de los empleados se corresponden con la rentabilidad financiera de Schroders. Para determinar la inversión en la remuneración cada año, se tienen en cuenta la solidez y la sostenibilidad del negocio, así como los informes de riesgo, jurídicos, de cumplimiento y de auditoría interna por parte de los responsables de estas áreas.

Los siguientes datos de remuneración reflejan los importes que se pagaron con respecto a la rentabilidad durante 2020.

- Los importes totales de remuneración que pagó SIM Europe a sus 317 empleados fueron de 52,35 millones de euros, de los que 32,93 millones de euros se destinaron a remuneración fija (por ejemplo, salarios, beneficios en especie) y 19,42 millones de euros se destinaron a remuneración variable (por ejemplo, bonificaciones anuales o bonificaciones diferidas). Los empleados de otras entidades del Grupo Schroders que trabajan como Consejeros de SIM Europe no reciben comisiones adicionales con respecto a su puesto en el Consejo de SIM Europe.
- Las siguientes disposiciones hacen referencia a los OICVM MRT de SIM Europe. La mayoría de estos OICVM MRT fueron contratados por otras empresas del grupo Schroders, lo que incluye la delegación por parte de SIM Europe de la gestión de las inversiones u otras responsabilidades a otras entidades del grupo Schroders o a terceros. Gran parte de dichos OICVM MRT prestan servicios a otras empresas y clientes del grupo Schroders. A efectos de transparencia, las cifras totales de remuneración que se muestran a continuación reflejan la remuneración completa de cada OICVM MRT de SIM Europe. La remuneración total general pagada a los 216 OICVM MRT de SIM Europe con respecto al ejercicio cerrado a 31 de diciembre de 2020, y atribuida a SIM Europe o a los fondos OICVM que gestiona, es de 180,01 millones de euros, de los cuales 41,92 millones de euros se pagaron al alto personal directivo, 132,83 millones de euros se pagaron a los MTR que se considera que corren riesgo por cuenta de SIM Europe o de los fondos OICVM que gestiona y 5,26 millones de euros se pagaron a otros OICVM MRT, incluidos los MRT con funciones de control. Estos valores de remuneración total incluyen los importes abonados por los delegados cuando están disponibles.

Para obtener información cualitativa adicional acerca de políticas y prácticas de remuneración, visite www.schroders.com/rem-disclosures.

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar)

Los subfondos participan en Operaciones de financiación de valores (SFT, por sus siglas en inglés) (tal como se definen en el Artículo 3 del Reglamento (UE) 2015/2365, son operaciones que incluyen operaciones de recompra, préstamo de valores o materias primas, operaciones de compraventa y operaciones de préstamo de márgenes). De conformidad con el Artículo 13 del Reglamento, a continuación se detalla la participación de los subfondos en relación con su exposición en swaps de rentabilidad total durante el ejercicio finalizado a 30 de septiembre de 2021:

Schroder GAIA Egerton Equity

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas en EUR	% de AUM
27.594.448	2,91%
Cantidad de activos - Posiciones cortas en EUR	% de AUM
24.495.144	2,58%
Cantidad de activos - Total en EUR	% de AUM
52.089.592	5,49%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes en EUR
Goldman Sachs	19.099.672
Morgan Stanley	16.371.304
J.P. Morgan	10.622.951
Merrill Lynch	5.907.769
UBS	87.896
	52.089.592

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en EUR
Efectivo	13.446.710
	13.446.710

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en EUR
menos de 1 día	13.446.710
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	13.446.710

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en EUR
EUR	13.446.710
	13.446.710

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas en EUR	Posiciones cortas en EUR	Total EUR
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	-	-
1 a 3 meses	19.442.353	1.838.778	21.281.131
3 a 12 meses	847.400	2.467.958	3.315.358
más de 1 año	7.304.695	20.188.408	27.493.103
vencimiento abierto	-	-	-
	27.594.448	24.495.144	52.089.592

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Goldman Sachs	Estados Unidos de América
Morgan Stanley	Estados Unidos de América
J.P. Morgan	Reino Unido
Merrill Lynch	Estados Unidos de América
UBS	Suiza

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositario	Valor de mercado en EUR
Morgan Stanley	13.446.710
	13.446.710

Garantías otorgadas

El porcentaje de garantías mantenidas en cuentas separadas o conjuntas, o cualquier otro tipo de cuenta respecto de los swaps de rentabilidad total, es el siguiente:

Tipo de cuenta	Valor de mercado en EUR
Separada	27.233.768
Conjunta	-
Otros	-
	27.233.768

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)

Rentabilidad y coste

Durante el ejercicio finalizado a 30 de septiembre de 2021, los datos sobre la rentabilidad y el coste de los swaps de rentabilidad total son los siguientes:

	% de rentabilidad general	Rentabilidad en EUR*
Intereses netos sobre swaps	-	-
Pérdidas netas materializadas	86,40%	111.793.002
Variación neta de la plusvalía latente	13,60%	17.598.082
	100,00%	129.391.084

* expresada en términos absolutos.

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados más arriba se incluye como parte de los "Ingresos netos sobre swaps" que se muestran en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en las "Ganancias/(pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total" y en la "Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total" en el Estado de variación patrimonial.

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Schroder GAIA Helix

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas en USD	% de AUM
-	-
Cantidad de activos - Posiciones cortas en USD	% de AUM
35.926.779	4,91%
Cantidad de activos - Total en USD	% de AUM
35.926.779	4,91%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes en USD
Goldman Sachs	25.967.501
J.P. Morgan	9.959.278
	35.926.779

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en USD
Efectivo	11.990.000
	11.990.000

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en USD
menos de 1 día	11.990.000
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	11.990.000

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en USD
USD	11.990.000
	11.990.000

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas en USD	Posiciones cortas en USD	Total USD
menos de 1 día	-	23.464.780	23.464.780
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	-	-
1 a 3 meses	-	-	-
3 a 12 meses	-	12.461.999	12.461.999
más de 1 año	-	-	-
vencimiento abierto	-	-	-
	-	35.926.779	35.926.779

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Goldman Sachs	Estados Unidos de América
J.P. Morgan	Reino Unido

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositario	Valor de mercado en USD
Goldman Sachs	11.990.000
	11.990.000

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Garantías otorgadas

El porcentaje de garantías mantenidas en cuentas separadas o conjuntas, o cualquier otro tipo de cuenta respecto de los swaps de rentabilidad total, es el siguiente:

Tipo de cuenta	Valor de mercado en USD
Separada	9.780.000
Conjunta	-
Otros	-
	9.780.000

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

Durante el ejercicio finalizado a 30 de septiembre de 2021, los datos sobre la rentabilidad y el coste de los swaps de rentabilidad total son los siguientes:

	% de rentabilidad general	Rentabilidad en USD*
Intereses netos sobre swaps	-	-
Pérdidas netas materializadas	88,02%	152.813.857
Variación neta de la plusvalía latente	11,98%	20.789.295
	100,00%	173.603.152

* expresada en términos absolutos.

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados más arriba se incluye como parte de los "Ingresos netos sobre swaps" que se muestran en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en las "Ganancias/(pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total" y en la "Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total" en el Estado de variación patrimonial.

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas en USD	% de AUM
3.502.822	1,03%
Cantidad de activos - Posiciones cortas en USD	% de AUM
8.405.710	2,49%
Cantidad de activos - Total en USD	% de AUM
11.908.532	3,52%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes en USD
Morgan Stanley	4.970.423
Goldman Sachs	4.307.910
Merrill Lynch	1.784.250
Credit Suisse	845.949
	11.908.532

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en USD
Efectivo	3.920.000
	3.920.000

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en USD
menos de 1 día	3.920.000
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	3.920.000

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en USD
USD	3.920.000
	3.920.000

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas en USD	Posiciones cortas en USD	Total USD
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	-	-
1 a 3 meses	-	-	-
3 a 12 meses	3.073.911	7.729.945	10.803.856
más de 1 año	428.911	675.765	1.104.676
vencimiento abierto	-	-	-
	3.502.822	8.405.710	11.908.532

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Morgan Stanley	Estados Unidos de América
Goldman Sachs	Estados Unidos de América
Merrill Lynch	Estados Unidos de América
Credit Suisse	Suiza

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositario	Valor de mercado en USD
Morgan Stanley	3.920.000
	3.920.000

Garantías otorgadas

A 30 de septiembre de 2021, no se otorgaron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

Durante el ejercicio finalizado a 30 de septiembre de 2021, los datos sobre la rentabilidad y el coste de los swaps de rentabilidad total son los siguientes:

	% de rentabilidad general	Rentabilidad en USD*
Intereses netos sobre swaps	-	-
Pérdidas netas materializadas	95,01%	67.473.343
Variación neta de la plusvalía latente	4,99%	3.546.270
	100,00%	71.019.613

* expresada en términos absolutos.

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados más arriba se incluye como parte de los "Ingresos netos sobre swaps" que se muestran en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en las "Ganancias/(pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total" y en la "Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total" en el Estado de variación patrimonial.

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas en USD	% de AUM
9.790.355	1,08%
Cantidad de activos - Posiciones cortas en USD	% de AUM
-	-
Cantidad de activos - Total en USD	% de AUM
9.790.355	1,08%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes en USD
Morgan Stanley	9.790.355
	9.790.355

El subfondo trata únicamente con Morgan Stanley para sus swaps de rentabilidad total.

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Plazo de vencimiento de las garantías

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Divisa de las garantías

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas en USD	Posiciones cortas en USD	Total USD
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	9.790.355	-	9.790.355
1 a 3 meses	-	-	-
3 a 12 meses	-	-	-
más de 1 año	-	-	-
vencimiento abierto	-	-	-
	9.790.355	-	9.790.355

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Morgan Stanley	Estados Unidos de América

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Garantías otorgadas

El porcentaje de garantías mantenidas en cuentas separadas o conjuntas, o cualquier otro tipo de cuenta respecto de los swaps de rentabilidad total, es el siguiente:

Tipo de cuenta	Valor de mercado en USD
Separada	34.100.000
Conjunta	-
Otros	-
	34.100.000

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías. Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

Durante el ejercicio finalizado a 30 de septiembre de 2021, los datos sobre la rentabilidad y el coste de los swaps de rentabilidad total son los siguientes:

	% de rentabilidad general	Rentabilidad en USD*
Intereses netos sobre swaps	-	-
Pérdidas netas materializadas	88,83%	47.244.778
Variación neta de la minusvalía latente	11,17%	5.943.202
	100,00%	53.187.980

* expresada en términos absolutos.

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados más arriba se incluye como parte de los "Ingresos netos sobre swaps" que se muestran en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en las "Ganancias/(pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total" y en la "Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total" en el Estado de variación patrimonial.

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas en USD	% de AUM
6.058.282	1,47%
Cantidad de activos - Posiciones cortas en USD	% de AUM
8.119.755	1,97%
Cantidad de activos - Total en USD	% de AUM
14.178.037	3,44%

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 30 de septiembre de 2021, no se recibieron valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes en USD
J.P. Morgan	5.146.462
Goldman Sachs	4.840.484
Morgan Stanley	4.191.091
	14.178.037

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en USD
Efectivo	1.345.000
	1.345.000

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en USD
menos de 1 día	1.345.000
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	1.345.000

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en USD
USD	1.345.000
	1.345.000

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas en USD	Posiciones cortas en USD	Total USD
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	-	-
1 a 3 meses	9.403	56.456	65.859
3 a 12 meses	441.592	271.858	713.450
más de 1 año	5.607.287	7.791.441	13.398.728
vencimiento abierto	-	-	-
	6.058.282	8.119.755	14.178.037

Anexo II - Operaciones de financiación de valores (sin auditar) (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
J.P. Morgan	Reino Unido
Goldman Sachs	Estados Unidos de América
Morgan Stanley	Estados Unidos de América

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositario	Valor de mercado en USD
Morgan Stanley	820.000
J.P. Morgan	284.000
Goldman Sachs	241.000
	1.345.000

Garantías otorgadas

El porcentaje de garantías mantenidas en cuentas separadas o conjuntas, o cualquier otro tipo de cuenta respecto de los swaps de rentabilidad total, es el siguiente:

Tipo de cuenta	Valor de mercado en USD
Separada	2.567.000
Conjunta	-
Otros	-
	2.567.000

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

Durante el ejercicio finalizado a 30 de septiembre de 2021, los datos sobre la rentabilidad y el coste de los swaps de rentabilidad total son los siguientes:

	% de rentabilidad general	Rentabilidad en USD*
Intereses netos sobre swaps	-	-
Pérdidas netas materializadas	87,16%	22.741.061
Variación neta de la minusvalía latente	12,84%	3.350.576
	100,00%	26.091.637

* expresada en términos absolutos.

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados más arriba se incluye como parte de los "Ingresos netos sobre swaps" que se muestran en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en las "Ganancias/(pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total" y en la "Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total" en el Estado de variación patrimonial.

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Anexo III - Divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (sin auditar)

Schroder GAIA Helix (el «Fondo») posee características medioambientales o sociales en el sentido que se les atribuye en el artículo 8 del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR», por sus siglas en inglés). En concreto, el Fondo promueve las siguientes características: mantiene una puntuación absoluta positiva en materia de sostenibilidad, según los criterios de calificación del Gestor de inversiones. La puntuación en materia de sostenibilidad se mide mediante la herramienta propia de Schroders, SustainEx™, que proporciona una estimación del posible impacto social o medioambiental que puede generar un emisor. Para ello, utiliza determinados parámetros con respecto a dicho emisor y cuantifica el impacto positivo (por ejemplo, el pago de «salarios justos») y el negativo (por ejemplo, las emisiones de carbono que genera un emisor) de cada parámetro para producir una puntuación general expresada como un porcentaje notional de las ventas del emisor subyacente pertinente. El emisor puede ser una sociedad o un emisor soberano. El Gestor de inversiones supervisa el cumplimiento de esta característica por referencia a la puntuación media ponderada en materia de sostenibilidad del Fondo en SustainEx™ durante el semestre anterior. El Fondo ha mantenido una puntuación absoluta positiva en materia de sostenibilidad según la metodología explicada anteriormente desde la fecha efectiva de los requisitos reglamentarios, el 10 de marzo de 2021.

Es posible que SustainEx™ no cubra todas las posiciones del Fondo puntualmente, en cuyo caso el Gestor de inversiones puede utilizar otros métodos para evaluar las posiciones pertinentes en el Fondo. Asimismo, algunos tipos de activos (por ejemplo, el efectivo y otros valores equivalentes, como los gilts) se consideran neutrales y, por tanto, nuestras herramientas propias no los contemplan.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof,
L-1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo
Tel.: (+352) 341 342 212
Fax: (+352) 341 342 342

GAIA 30 de septiembre de 2021 ESES