

I de capitalisation USD | Données au 31.01.2022

## Objectifs et politique d'investissement du fonds

Le fonds vise à atteindre un rendement positif après déduction des frais sur une période de trois ans en investissant dans des actions du monde entier, y compris des marchés émergents. Le fonds peut aussi investir dans des obligations et des devises du monde entier, y compris des marchés émergents. Le fonds est activement géré et met en œuvre un ensemble de stratégies diversifiées sur différents marchés et différentes catégories d'actifs. Le fonds investit dans des actions, des obligations, des devises et des matières premières de même que dans des fonds investissant dans de tels instruments. Le fonds peut investir jusqu'à 50 % de son actif dans des obligations de moindre qualité (obligations dont la notation est inférieure à « investment grade » telle que mesurée par Standard & Poor's ou toute notation équivalente d'autres agences de notation de crédit). Le fonds peut investir jusqu'à 20 % de son actif dans des titres adossés à des créances hypothécaires et des titres adossés à des actifs. Le fonds peut investir dans des obligations convertibles et des obligations avec warrants ainsi que jusqu'à 10 % dans obligations convertibles conditionnelles. Les investissements sur les marchés des matières premières se feront indirectement en utilisant une combinaison d'indices de matières premières et d'autres actifs éligibles sous-jacents. Le fonds investit dans des actions de sociétés chinoises cotées et négociées en RMB sur des Bourses chinoises telles que les Bourses de Shenzhen ou de Shanghai. Le fonds peut investir directement (au moyen de détentions matérielles) et/ou indirectement (au moyen de produits dérivés). Le fonds peut avoir largement recours à des instruments dérivés, longs ou courts, dans le but de réaliser des plus-values d'investissement, de réduire les risques ou de gérer le fonds de manière plus efficace. Le fonds peut détenir des positions nettes longues ou nettes courtes jusqu'à des positions longues et courtes sont associées. Le fonds peut avoir recours à l'effet de levier et détenir des liquidités. Le fonds peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs dans des fonds d'investissement à capital variable et des ETF. Le fonds maintient une note de durabilité absolue positive, selon le système de notation du gestionnaire d'investissement. Recommandation : Il est conseillé aux investisseurs d'obtenir un conseil indépendant et de s'assurer qu'ils comprennent les techniques employées par les gérants.

Le compartiment présente des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'article 8 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (le « Règlement SFDR »).

**Les risques associés à un investissement dans ce compartiment sont indiqués au verso et doivent faire l'objet d'un examen attentif avant de procéder à tout investissement. L'Objectif d'investissement du compartiment est indiqué ci-dessus. Pour de plus amples informations sur la Politique d'investissement du compartiment, veuillez consulter le DICI. Pour plus de détails sur la politique d'investissement du compartiment, veuillez vous reporter au document d'information clé pour l'investisseur (DICI) du compartiment.**

**Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs et pourraient ne pas se répéter. La valeur des investissements et le revenu qu'ils peuvent générer peut évoluer à la hausse comme à la baisse et il est possible que les investisseurs ne récupèrent pas les montants initialement investis. Les taux de change peuvent faire évoluer la valeur des investissements étrangers à la hausse comme à la baisse.**

## Performance des catégories de parts (%)

Performance cumulée	1 mois	3 mois	Depuis le début de l'année	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le lancement
Catégorie de parts (net)	-2,0	-3,6	-2,0	-0,8	25,5	-	21,6
Indice de comparaison 1	-4,9	-3,5	-4,9	13,2	53,7	-	48,1
Indice de comparaison 2	0,5	1,3	0,5	0,5	-4,5	-	-8,1

## Notations et accréditation



Reportez-vous à la section « Source et informations sur les notations » pour obtenir de plus amples informations sur les icônes affichées ci-dessus.

Performance sur 12 mois	Performance annuelle - Janv.					Performance calendaire				
	2017	2018	2019	2020	2021	2017	2018	2019	2020	2021
	-	-	-	-	-	2018	2019	2020	2021	2022
Catégorie de parts (net)	-	-	7,8	17,3	-0,8	-	-	6,4	15,2	4,2
Indice de comparaison 1	-	-	16,0	17,0	13,2	-	-	26,6	16,3	18,5
Indice de comparaison 2	-	-	-3,5	-1,4	0,5	-	-	-1,9	-3,9	1,0

## Performance sur 5 ans %



I de capitalisation USD | Données au 31.01.2022

Performance mensuelle	Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juill.	Août	Sept	Oct.	Nov.	Déc.	Fin de l'exercice
<b>2020</b>													
<b>Catégorie de parts (net)</b>	1,2	0,5	-3,7	1,7	1,4	2,0	2,5	0,8	1,0	1,8	2,0	3,3	15,2
<b>Indice de comparaison 1</b>	-1,1	-8,1	-13,5	10,7	4,3	3,2	5,3	6,1	-3,2	-2,4	12,3	4,6	16,3
<b>Indice de comparaison 2</b>	-1,5	-0,4	-5,9	-0,9	2,0	2,1	-1,9	0,7	-0,8	0,5	2,3	0,3	-3,9
<b>2021</b>													
<b>Catégorie de parts (net)</b>	3,0	1,4	0,3	0,1	0,4	-1,4	2,1	-0,2	0,2	0,2	-1,1	-0,6	4,2
<b>Indice de comparaison 1</b>	-0,5	2,3	2,7	4,4	1,6	1,3	0,7	2,5	-4,1	5,1	-2,4	4,0	18,5
<b>Indice de comparaison 2</b>	1,0	0,2	1,3	0,6	0,2	-0,8	-0,9	-0,4	0,2	-1,2	-0,2	1,1	1,0
<b>2022</b>													
<b>Catégorie de parts (net)</b>	-2,0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Indice de comparaison 1</b>	-4,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Indice de comparaison 2</b>	0,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### Facteurs de risque

**Facteur de risque de durabilité :** Le fonds présente des caractéristiques environnementales et/ou sociales. Cela signifie qu'il peut avoir une exposition limitée à certaines sociétés, industries ou certains secteurs et peut renoncer à certaines opportunités d'investissement ou céder certaines participations qui ne correspondent pas à ses critères de durabilité. Par conséquent, le fonds peut sous-performer d'autres fonds qui n'appliquent pas de critères similaires. Le fonds peut investir dans des sociétés qui ne reflètent pas les croyances et les valeurs d'un investisseur particulier.

**Risque lié aux instruments dérivés – Gestion efficace du portefeuille et objectifs d'investissement :** les instruments dérivés peuvent être utilisés pour gérer efficacement le portefeuille. Un instrument dérivé peut ne pas se comporter comme prévu, entraîner des pertes plus importantes que le coût de l'instrument dérivé ainsi que des pertes pour le fonds. Le fonds peut également investir de manière significative dans des instruments dérivés, notamment en utilisant des techniques de vente à découvert et d'effet de levier dans le but de générer un rendement. Lorsque la valeur d'un actif change, la valeur d'un instrument dérivé basé sur cet actif peut évoluer de manière plus significative. Cela peut entraîner des pertes supérieures à celles d'un investissement dans l'actif sous-jacent.

**Veillez consulter le DICI et le Prospectus pour obtenir une liste complète des considérations relatives aux risques applicables à ce compartiment.**

### Caractéristiques du fonds

Gérant(s) du fonds	Darren Hodges Robert Donald
Depuis le	12.05.2020 ; 23.05.2018
Société de gestion	Schroder Investment Management (Europe) S.A.
Domiciliation	Luxembourg
Date de lancement du fonds	23.05.2018
Date de lancement de la catégorie de parts	23.05.2018
Devise de référence du fonds	USD
Devise de la catégorie de parts	USD
Taille du fonds (en millions)	USD 851,01
Indice de comparaison 1	MSCI ACWI NR
Indice de comparaison 2	HFRX EH: Equity Market Neutral Index
Cours de l'action en fin de mois	USD 121,5700
Fréquence de négociation	Quotidienne
Délai de règlement	3 jours ouvrables suivant la transaction
Fréquence de distribution	Pas de distribution
Période de préavis	Souscriptions : T-2 ; Rachats : T-2

### Commissions et frais

Commission de performance	20 % (15 % pour la catégorie E) (le multiple) de la surperformance absolue par rapport à un High Water Mark
Frais courants	0,14%
Frais d'entrée maximum	0,00%

### Informations de souscription

Montant minimum de souscription initiale	USD 5M ; EUR 5M ou l'équivalent proche dans une autre devise librement convertible.
--	---

### Codes

ISIN	LU1809996397
Bloomberg	SCGHEIU LX
SEDOL	BZ1MJZ7
Reuters	LU1809996397.LUF

### Indicateur de risque SRI

**À RISQUE PLUS FAIBLE**  
Performance généralement plus faible

**À RISQUE PLUS ÉLEVÉ**  
Performance généralement plus élevée



La catégorie de risque a été calculée à l'aide de données de performance historique et peut ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur du Compartiment. Rien ne garantit que la catégorie de risque du compartiment restera inchangée. Veuillez consulter le Document d'information clé pour l'investisseur pour en savoir plus.

### Indicateurs de risque et ratios financiers

	Fonds	Indice de comparaison 1
<b>Volatilité annualisée (%) (3 ans)</b>	5,0	17,1
<b>Bêta (%) (3 ans)</b>	0,2	-
<b>Ratio de Sharpe (3 ans)</b>	1,4	0,9

Source: Morningstar. Les ratios ci-dessus sont basés sur des données de performance établies sur la base des cours acheteurs à cours acheteurs.

### Allocation d'actifs

Source: Schroders. Les principales participations et l'allocation d'actifs s'entendent au niveau du fonds.

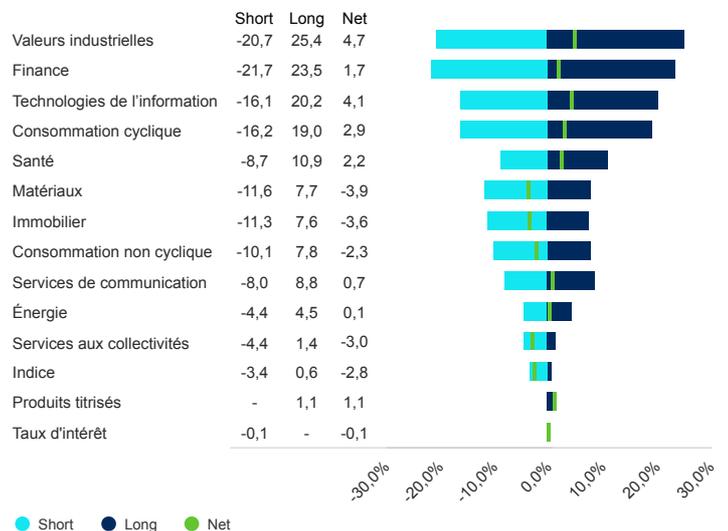
Dans la mesure du possible, les expositions ont été fournies selon l'analyse du sous-jacent pour les contrats à terme sur indices, les positions TRS et les paniers CFD. Dans certains cas, un indicateur indirect peut avoir été utilisé. L'analyse du sous-jacent n'a été fournie pour les options. L'exposition brute est calculée sur une base nette-brute au niveau du fonds, ce qui signifie que les positions longues et courtes sur un même émetteur sont agrégées au niveau du fonds avant de calculer l'exposition brute. L'exposition à la capitalisation boursière exclut les expositions au crédit, aux taux d'intérêt et aux obligations (d'entreprise).

Les positions en TRS sur indices ont été décomposées afin d'obtenir une représentation du risque correcte. Par conséquent, l'exposition de l'indice sous-jacent à chaque valeur qui le compose a été agrégée avec la position individuelle longue ou courte sur ces valeurs au sein du portefeuille. Les données des systèmes internes de Schroders ont permis de remplir les systèmes de risque utilisés dans l'analyse. Les valeurs indiquées peuvent donc varier par rapport aux fichiers du dépositaire.

### Expositions (%)

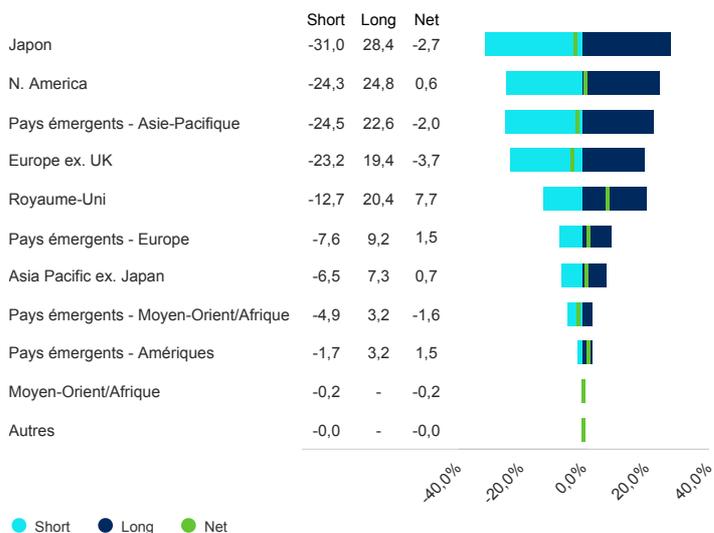
Pos. longues actions	135,4
Pos. courtes actions	-133,2
Pos. longues options sur actions	0,6
Pos. courtes options sur actions	-1,0
Crédit long	2,4
Pos. courtes taux	-0,1
Pos. courtes - futures sur actions	-2,4
<b>Exposition nette du fonds</b>	<b>1,7</b>
<b>Exposition brute du fonds</b>	<b>275,2</b>

### Secteur (%)



I de capitalisation USD | Données au 31.01.2022

### Zone géographique (%)



### Tailles de capitalisation (%)



### 10 principales positions longues (%)

Libellé de la position	%
HDFC BANK LTD	1,5
AIA GROUP LTD	1,1
RELX PLC	1,1
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	1,0
TENCENT HOLDINGS LTD	1,0
BOOKING HOLDINGS INC	0,9
ENI SPA	0,9
TEXAS INSTRUMENTS INC	0,8
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0,8
MIDEA GROUP CO LTD	0,8

### 10 principales positions courtes (%)

Libellé de la position	%
Index 1	-2,0
Technologies de l'information	-1,5
Index 2	-1,0
Consommation non cyclique	-0,9
Matériaux	-0,8
Consumer Discretionary 1	-0,7
Finance	-0,7
Consumer Discretionary 2	-0,7
Services de communication	-0,7
Consumer Discretionary 3	-0,7

Dans la mesure du possible, les expositions ont été fournies selon l'analyse du sous-jacent pour les contrats à terme sur indices, les positions TRS et les paniers CFD. Dans certains cas, un indicateur indirect peut avoir été utilisé. L'analyse du sous-jacent n'a été fournie pour les options. L'exposition brute est calculée sur une base nette-brute au niveau du fonds, ce qui signifie que les positions longues et courtes sur un même émetteur sont agrégées au niveau du fonds avant de calculer l'exposition brute. L'exposition à la capitalisation boursière exclut les expositions au crédit, aux taux d'intérêt et aux obligations (d'entreprise).

Les positions en TRS sur indices ont été décomposées afin d'obtenir une représentation du risque correcte. Par conséquent, l'exposition de l'indice sous-jacent à chaque valeur qui le compose a été agrégée avec la position individuelle longue ou courte sur ces valeurs au sein du portefeuille. Les données des systèmes internes de Schroders ont permis de remplir les systèmes de risque utilisés dans l'analyse. Les valeurs indiquées peuvent donc varier par rapport aux fichiers du dépositaire.

### Coordonnées

Schroder Investment Management (Europe) S.A.  
5, rue Höhenhof  
Sennigerberg  
Luxembourg  
L-1736  
Téléphone: +352 341 342 202  
Fax: +352 341 342 342

Pour votre sécurité, les communications peuvent être enregistrées et surveillées.

I de capitalisation USD | Données au 31.01.2022

## Indice de référence et activités liées au fonds

Certains écarts de performance peuvent survenir entre l'heure d'arrêté de valorisation du fonds et celle de l'indice de référence, car la performance du fonds est calculée à une heure différente de celle de l'indice. Robert Donald et Darren Hodges ont remplacé Robert Donald en tant que gérants de ce fonds le 12.05.2020. Les performances du fonds doivent être évaluées par rapport à son indice de référence cible, à savoir fournir un rendement positif après déduction des frais sur une période de trois ans et par comparaison à l'HFRX EH : L'indice Equity Market Neutral et l'indice MSCI AC World (Net TR). Les indices de référence comparateurs ne sont inclus qu'à des fins de comparaison des performances et n'ont aucune influence sur la manière dont le gestionnaire d'investissement investit les actifs du fonds. Par rapport à l'indice MSCI AC World (Net TR), l'univers d'investissement du fonds devrait se recouper, directement ou indirectement, dans une mesure limitée, avec les composantes de l'indice de référence comparateur. Le ou les indices de référence ne tient/tiennent pas compte des caractéristiques environnementales et sociales ou de l'objectif durable (le cas échéant) du fonds. Veuillez vous reporter à l'annexe III du prospectus du fonds pour plus de détails.

## Source et informations sur les notations

**Scores d'impact :** Ceux-ci sont générés à l'aide de l'outil exclusif de Schroders, SustainEx™, qui fournit une estimation de l'impact social ou environnemental potentiel qu'une société ou un autre émetteur peut créer. Pour ce faire, il utilise certains indicateurs relatifs à cet émetteur et quantifie les impacts positifs et négatifs en termes économiques afin de produire une mesure globale. Tous ces indicateurs ne sont pas représentés dans les scores d'impact sur les « Personnes » et sur la « Planète », et la manière dont ces scores sont générés peut évoluer au fil du temps. Il utilise et s'appuie sur des données tierces (y compris des estimations de tiers) ainsi que sur les hypothèses de modélisation propres à Schroders, et le résultat diffère d'autres outils et mesures en matière de durabilité. Lorsque SustainEx™ s'appuie sur des données et des estimations produites par des tiers, Schroders cherche à s'assurer que ces données et estimations sont exactes, mais Schroders ne peut pas garantir et ne garantit pas l'exactitude, l'exhaustivité et le caractère approprié de ces données et estimations tierces. Comme tout modèle, SustainEx™ évoluera et se développera au fil du temps à mesure que Schroders continue d'évaluer, d'affiner et d'ajouter des indicateurs ainsi que leurs contributions relatives. La génération de scores SustainEx™ implique un élément de jugement et de subjectivité parmi les différents indicateurs choisis par Schroders. Par conséquent, Schroders n'accepte aucune responsabilité découlant d'une inexactitude ou d'une omission dans les scores SustainEx™, ou résultant de leur utilisation ou de la confiance accordée à ces scores. Au fur et à mesure de l'évolution du modèle, les modifications apportées à la manière dont les indicateurs sont appliqués peuvent entraîner des modifications du score SustainEx™ de tout émetteur et, en définitive, du score global du compartiment/portefeuille. Dans le même temps, bien entendu, les performances SustainEx de l'émetteur sont susceptibles de s'améliorer ou de se dégrader.

**Notation MSCI ESG Research :** Fournie par MSCI ESG Research à compter de la « date du rapport ». Les indicateurs et les notations de fonds recueillis par MSCI ESG Research LLC (« MSCI ESG ») (les « Informations ») fournissent des données environnementales, sociales et de gouvernance relatives aux titres sous-jacents de plus de 31 000 fonds commun de placement et ETF multi-actifs dans le monde. MSCI ESG est un conseiller en investissement agréé en vertu de la loi américaine de 1940, la « U.S. Investment Advisers Act ». Les données de MSCI ESG n'ont pas été soumises à la U.S. Securities and Exchange Commission ni à aucun autre organisme de réglementation, et n'ont pas reçu leur approbation. Aucune de ces Informations ne constitue une offre d'achat ou de vente, ni une promotion ou une recommandation d'un titre, d'un instrument financier, d'un produit ou d'une stratégie de négociation, ni ne doit être considérée comme une indication ou une garantie de performances, d'analyses, de prévisions ou de projections futures. Les Informations ne doivent pas être utilisées dans le but de déterminer quels titres acheter ou vendre ou à quel moment les acheter ou les vendre. Les Informations sont fournies « en l'état », et l'utilisateur des Informations assume l'intégralité du risque lié à l'utilisation qu'il pourrait en faire ou permettre d'en faire.

Schroders utilise SustainEx™ pour estimer l'impact net d'un portefeuille d'investissement en tenant compte de certaines mesures de durabilité par rapport à l'indice de référence d'un produit, le cas échéant. Pour ce faire, il utilise des données tierces ainsi que les estimations et hypothèses propres à Schroders et le résultat peut différer d'autres outils et mesures de développement durable. Source de toutes les données de performances, sauf indication contraire : Morningstar, cours acheteur à cours acheteur, revenu net réinvesti, net de frais.

**Notation Morningstar :** © Morningstar 2022. Tous droits réservés. Les informations fournies ici : (1) sont la propriété de Morningstar et/ou de ses fournisseurs de contenu ; (2) ne peuvent être ni copiées ni distribuées ; et (3) aucune garantie ne peut être fournie quant à leur exactitude, leur intégralité ou leur actualité. Ni Morningstar ni ses fournisseurs de contenu peuvent être tenus responsables des dommages ou pertes découlant de l'usage des présentes informations. Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs.

I de capitalisation USD | Données au 31.01.2022

**Informations importantes**

Schroder GAIA (la "Société") est une Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV) de droit luxembourgeois et est coordonnée au regard de la réglementation européenne. La Société et certains de ses compartiments ont obtenu l'autorisation de commercialisation en France de l'Autorité des Marchés Financiers. Ce document ne constitue en aucun cas une offre contractuelle ni une offre ou une sollicitation en vue de la souscription des actions de la Société. Aucune information ou affirmation contenue dans ce document ne doit être considérée comme une recommandation. Les souscriptions des actions de la Société ne peuvent être effectuées que sur la base du document d'informations clés pour l'investisseur et du prospectus en vigueur, accompagné du dernier rapport annuel audité (ainsi que de tout rapport semestriel non-audité si celui-ci a été publié ultérieurement). Des exemplaires de ces documents peuvent être obtenus gratuitement auprès de Schroder Investment Management (Europe) S.A. ou du correspondant centralisateur de la Société en France, Société Générale, 29 boulevard Haussmann, F-75009. **Tout investissement dans la Société comporte des risques qui sont définis de manière plus détaillée dans le document d'informations clés pour l'investisseur et le prospectus. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Les cours des actions ainsi que le revenu qui en découle peuvent évoluer à la baisse comme à la hausse et les investisseurs peuvent ne pas récupérer le montant qu'ils ont investi.** Schroders est responsable du traitement de vos données personnelles. Pour obtenir des informations sur la façon dont Schroders pourrait traiter vos données personnelles, veuillez consulter notre Politique de confidentialité disponible à l'adresse suivante: [www.schroders.com/en/privacy-policy](http://www.schroders.com/en/privacy-policy) ou sur demande au cas où vous n'auriez pas accès à cette page Web. Ce document est produit par Schroder Investment Management (Europe) S.A., 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Luxembourg.R.C. Luxembourg B 37.799. Pour votre sécurité, les communications peuvent être enregistrées et surveillées. D'autres catégories de parts pour ce fonds pourraient être disponibles Schroders est responsable du traitement de vos données personnelles. Pour obtenir des informations sur la façon dont Schroders pourrait traiter vos données personnelles, veuillez consulter notre Politique de confidentialité disponible à l'adresse suivante: [www.schroders.com/en/privacy-policy](http://www.schroders.com/en/privacy-policy) ou sur demande au cas où vous n'auriez pas accès à cette page Web. Les données de parties tierces sont la propriété du fournisseur de données ou celui-ci y est autorisé sous licence, et ne peuvent être reproduites ou extraites et utilisées à aucune autre fin sans l'autorisation du fournisseur de données. Ces données sont fournies sans aucune garantie de quelque nature que ce soit. Le fournisseur des données et l'émetteur du document ne peuvent aucunement être tenus responsables par rapport aux données de parties tierces. Le prospectus et/ou [www.schroders.com](http://www.schroders.com) contiennent les avertissements supplémentaires applicables aux données des parties tierces