

Portfel inwestycji na dzień 31 grudnia 2015 r. (ciąg dalszy)

Schroder ISF Asian Bond Absolute Return (ciąg dalszy)

Liczba akcji lub kwota kapitału	Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego będące przedmiotem obrotu na innym rynku regulowanym	Wartość rynkowa USD	% aktywów netto
Malezja		54 075 650	8,99
MYR 5 200 000	Malaysia Government 3.394% 15/03/2017	1 221 907	0,20
MYR 173 600 000	Malaysia Government 3.659% 15/10/2020	40 797 112	6,79
MYR 18 450 000	Malaysia Government 3.82% 15/11/2016	4 351 807	0,72
USD 8 000 000	Petronas Capital RegS 3.5% 18/03/2025	7 704 824	1,28
Filipiny		34 631 108	5,76
PHP 240 000 000	Philippine Government 3.9% 26/11/2022	4 933 142	0,82
PHP 300 000 000	Philippine Government 6.25% 14/01/2036	7 101 279	1,18
PHP 825 000 000	Philippine Government 7% 27/01/2016	17 639 452	2,93
PHP 220 000 000	Philippine Government 7% 31/03/2017	4 957 235	0,83
Singapur		20 972 093	3,49
USD 4 500 000	Global Logistic Properties 3.875% 04/06/2025	4 412 506	0,74
SGD 21 500 000	Singapore Government 2.375% 01/06/2025	14 918 075	2,48
USD 1 700 000	STATS ChipPAC RegS 8.5% 24/11/2020	1 641 512	0,27
Tajlandia		38 909 199	6,47
THB 550 000 000	Thailand Government 1.2% 14/07/2021	15 425 220	2,56
THB 940 000 000	Thailand Government 1.25% 12/03/2028	23 483 979	3,91
Stany Zjednoczone		8 988 491	1,49
USD 4 000 000	US Treasury Bill 0% 21/04/2016	3 998 069	0,66
USD 5 000 000	US Treasury Bill 0% 02/06/2016	4 990 422	0,83
Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego będące przedmiotem obrotu na innym rynku regulowanym ogółem		234 159 648	38,94
Liczba akcji lub kwota kapitału	Liczba jednostek uczestnictwa w otwartym funduszu inwestycyjnym w planie zbiorowego inwestowania	Wartość rynkowa USD	% aktywów netto
Specjalny Region Administracyjny Hongkong		21 778 907	3,62
CNH 965 500	Schroder Umbrella Fund II - Schroder China Fixed Income I CNH	16 163 407	2,69
USD 550 000	Schroder Umbrella Fund II - Schroder China Fixed Income I USD	5 615 500	0,93
Luksemburg		22 620 000	3,76
USD 217 500	Schroder ISF RMB Fixed Income Class I Acc	22 620 000	3,76
Łączna liczba jednostek uczestnictwa w otwartym funduszu inwestycyjnym		44 398 907	7,38
Inwestycje ogółem		565 633 518	94,06
Pozostałe aktywa netto		35 744 847	5,94
Wartość aktywów netto		601 378 365	100,00

Schroder ISF Emerging Markets Debt Absolute Return

Liczba akcji lub kwota kapitału	Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego dopuszczone do oficjalnych notowań na giełdzie papierów wartościowych	Wartość rynkowa USD	% aktywów netto
Brazylia		29 603 354	0,95
BRL 6 880 000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 01/01/2021	13 843 701	0,44
BRL 8 306 000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 01/01/2023	15 759 653	0,51
Kolumbia		21 960 576	0,70
USD 23 040 000	Colombia Government 4% 26/02/2024	21 960 576	0,70
Republika Czeska		244 127 042	7,83
CZK 905 550 000	Czech Republic 0.85% 17/03/2018	37 420 680	1,20
CZK 4 843 450 000	Czech Republic 4% 11/04/2017	206 706 362	6,63
Ekwador		2 944 626	0,10
USD 3 950 000	Ecuador Government RegS 7.95% 20/06/2024	2 944 626	0,10
Indonezja		71 528 898	2,29
IDR 181 250 000 000	Indonesia Government 7.875% 15/04/2019	12 815 739	0,41
IDR 143 100 000 000	Indonesia Government 8.25% 15/05/2036	9 743 306	0,31
IDR 361 945 000 000	Indonesia Government 8.375% 15/03/2024	25 622 162	0,82
IDR 238 400 000 000	Indonesia Government 8.375% 15/09/2026	16 843 948	0,54
IDR 95 330 000 000	Indonesia Government 8.375% 15/03/2034	6 503 743	0,21
Meksyk		532 002 598	17,05
MXN 656 000 000	Mexican Bonos 10% 05/12/2024	47 893 180	1,54
MXN 2 878 500 000	Mexico Cetes 0% 04/02/2016	160 715 949	5,15
MXN 1 450 000 000	Mexico Cetes 0% 26/05/2016	81 150 783	2,60
MXN 635 800 000	Mexico Cetes 0% 26/05/2016	35 659 997	1,14
MXN 1 634 204 100	Mexico Cetes 0% 23/06/2016	91 416 905	2,93
MXN 1 700 000 000	Mexico Cetes 0% 18/08/2016	95 059 669	3,05
USD 20 600 000	Mexico Government 3.6% 30/01/2025	20 106 115	0,64
Polska		230 375 039	7,39
PLN 57 000 000	Poland Government 4.75% 25/04/2017	15 144 215	0,49
PLN 706 400 000	Poland Government 5% 25/04/2016	182 131 983	5,84
PLN 122 000 000	Poland Government 5.25% 25/10/2017	33 098 841	1,06
Korea Południowa		73 550 324	2,36
KRW 57 050 000 000	Korea Treasury Bond 3% 10/12/2016	49 130 574	1,58
KRW 27 000 000 000	Korea Treasury Bond 5.5% 10/09/2017	24 419 750	0,78
Ponadnarodowe		75 286 017	2,41
INR 2 164 000 000	International Finance 7.8% 03/06/2019	33 704 815	1,08
INR 1 200 000 000	International Finance 8.25% 10/06/2021	19 090 612	0,61
INR 1 500 000 000	International Finance GMTN 6.45% 30/10/2018	22 490 590	0,72
Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego dopuszczone do oficjalnych notowań na giełdzie papierów wartościowych ogółem		1 281 378 474	41,08
Liczba akcji lub kwota kapitału	Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego będące przedmiotem obrotu na innym rynku regulowanym	Wartość rynkowa USD	% aktywów netto
Brazylia		71 400 262	2,29
BRL 37 034 000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 01/01/2025	71 400 262	2,29
Ekwador		15 151 446	0,48
USD 18 650 000	Ecuador Government RegS 10.5% 24/03/2020	15 151 446	0,48
Rosja		125 279 894	4,02
RUB 1 569 420 000	Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023	18 330 694	0,59

Portfel inwestycji na dzień 31 grudnia 2015 r. (ciąg dalszy)

Schroder ISF Emerging Markets Debt Absolute Return (ciąg dalszy)

Liczba akcji lub kwota kapitału	Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego będące przedmiotem obrotu na innym rynku regulowanym	Wartość rynkowa USD	% aktywów netto
Rosja (ciąg dalszy)			
RUB 4 848 520 000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/04/2028	54 695 255	1,75
RUB 379 100 000	Russian Federal Bond - OFZ 7.6% 20/07/2022	4 636 780	0,15
RUB 989 200 000	Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 03/02/2027	12 240 529	0,39
USD 35 400 000	Russian Foreign - Eurobond RegS 3.25% 04/04/2017	35 376 636	1,14
Singapur		229 835 339	7,37
SGD 159 400 000	Singapore Government 2.375% 01/04/2017	114 698 975	3,68
SGD 160 000 000	Singapore Government 3.75% 01/09/2016	115 136 364	3,69
Republika Południowej Afryki		15 427 279	0,49
ZAR 228 950 000	South Africa Government 10.5% 21/12/2026	15 427 279	0,49
Stany Zjednoczone		1 256 841 273	40,29
USD 16 000 000	US Treasury 2.25% 15/11/2025	15 966 250	0,52
USD 35 080 000	US Treasury 2.875% 15/08/2045	34 035 822	1,09
USD 17 960 000	US Treasury 3% 15/05/2045	17 858 974	0,58
USD 130 000 000	US Treasury Bill 0% 07/01/2016	129 996 422	4,17
USD 80 000 000	US Treasury Bill 0% 28/01/2016	79 993 864	2,56
USD 200 000 000	US Treasury Bill 0% 04/02/2016	199 964 999	6,41
USD 100 000 000	US Treasury Bill 0% 18/02/2016	99 975 504	3,20
USD 50 000 000	US Treasury Bill 0% 03/03/2016	49 979 903	1,60
USD 120 000 000	US Treasury Bill 0% 21/04/2016	119 944 243	3,84
USD 70 000 000	US Treasury Bill 0% 05/05/2016	69 929 356	2,24
USD 190 000 000	US Treasury Bill 0% 26/05/2016	189 706 125	6,08
USD 110 000 000	US Treasury Bill 0% 02/06/2016	109 782 421	3,52
USD 140 000 000	US Treasury Bill 0% 09/06/2016	139 707 390	4,48
Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego będące przedmiotem obrotu na innym rynku regulowanym ogółem		1 713 935 493	54,94
Inwestycje ogółem		2 995 313 967	96,02
Pozostałe aktywa netto		124 198 843	3,98
Wartość aktywów netto		3 119 512 810	100,00

Schroder ISF EURO Credit Absolute Return*

Liczba akcji lub kwota kapitału	Zbywalne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego dopuszczone do oficjalnych notowań na giełdzie papierów wartościowych	Wartość rynkowa EUR	% aktywów netto
Australia			
EUR 120 000	BHP Billiton Finance variable 4.75% 22/04/2076	118 415	0,47
Austria			
EUR 100 000	UNIQA Insurance EMTN variable 31/07/2043	110 539	0,44
Belgia			
EUR 1 000 000	Befius Bank EMTN 1.125% 22/05/2017	1 011 300	4,04
Dania			
GBP 170 000	Danske Bank EMTN variable 29/09/2021	243 537	0,97
Francja			
EUR 200 000	Accor 2.5% 21/03/2019	210 621	0,84
EUR 100 000	BPCE EMTN variable 30/11/2027	100 492	0,40
EUR 500 000	Cap Gemini 1.75% 01/07/2020	512 520	2,05
EUR 100 000	Groupama variable 27/10/2039	107 218	0,43
EUR 200 000	Havas 1.875% 08/12/2020	199 481	0,80
EUR 1 000 000	HSBC France EMTN FRN 0.446% 27/11/2019	1 000 135	3,99
EUR 200 000	Iliad 2.125% 05/12/2022	197 020	0,79
EUR 430 000	Orange variable perpetual	436 913	1,74
EUR 250 000	RCI Banque EMTN 1.375% 17/11/2020	252 025	1,01
EUR 100 000	SEB 2.375% 25/11/2022	101 343	0,40
EUR 300 000	Societe Des Autoroutes Paris-Rhin-Rhone EMTN FRN 03/01/2020	300 601	1,20
EUR 500 000	Societe Fonciere Lyonnaise 2.25% 16/11/2022	503 786	2,01
Niemcy			
EUR 500 000	Deutsche Pfandbriefbank AG EMTN 1.375% 15/01/2018	504 201	2,01
EUR 250 000	Deutsche Wohnen 1.375% 24/07/2020	252 341	1,01
EUR 250 000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg EMTN variable 02/04/2076	232 441	0,93
EUR 500 000	Grand City Properties 2% 29/10/2021	504 160	2,01
EUR 500 000	Infineon Technologies 1% 10/09/2018	498 150	1,99
EUR 400 000	Vonovia Finance EMTN 1.625% 15/12/2020	399 238	1,59
Islandia			
EUR 370 000	Landsbankinn EMTN 3% 19/10/2018	374 185	1,49
Irlandia			
EUR 100 000	Allied Irish Banks EMTN variable 26/11/2025	100 802	0,40
EUR 470 000	Bank of Ireland EMTN variable 11/06/2024	487 672	1,95
EUR 240 000	Ryanair EMTN 1.875% 17/06/2021	246 555	0,98
Izrael			
EUR 460 000	Teva Pharmaceutical Finance IV 2.875% 15/04/2019	487 958	1,95
Włochy			
EUR 490 000	Banco Popolare EMTN 2.75% 27/07/2020	490 196	1,96
EUR 230 000	Beni Stabili 4.125% 22/01/2018	241 557	0,96
EUR 230 000	FCA Capital Ireland EMTN 2.875% 26/01/2018	238 287	0,95
EUR 120 000	Generali Finance EMTN variable perpetual	116 610	0,47
EUR 240 000	Iren EMTN 2.75% 02/11/2022	248 747	0,99
EUR 2 000 000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.25% 01/08/2017	2 166 616	8,65
Holandia			
GBP 200 000	ABN AMRO Bank EMTN 2.375% 07/12/2021	268 920	1,08

* Szczegółowe informacje na temat wszelkich transakcji kapitałowych, jakie miały miejsce w analizowanym roku, można znaleźć w Sprawozdaniu Zarządu.