

CS Investment Funds 14

Investment Fund under Luxembourg law –

R.C.S. K673

**Geprüfter Jahresbericht zum
31.03.2024**

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
Prüfungsvermerk	4
Kombinierter Bericht	10
Erläuterungen	12
Tätigkeitsbericht (ungeprüft)	15
Bericht per Subfonds	
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	17
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	22
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	27
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund (bis zum 11.03.2024)	32
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	35
Ungeprüfte Informationen	
Vergütung	40
Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")	40
Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen	43

Verwaltung und Organe

Verwaltungsgesellschaft

Credit Suisse Fund Management S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg
R.C.S. Luxemburg B72925

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Daniela Klasén-Martin (bis zum 16.01.2024)
Managing Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Thomas Nummer (bis zum 30.04.2023)
Independent Director, Luxemburg

Markus Ruetimann (bis zum 16.01.2024)
Managing Director, Credit Suisse Asset Management Limited, Vereinigtes
Königreich

Ann-Charlotte Lawyer (seit dem 16.01.2024)
Independent Director, Luxemburg

Francesca Prym (seit dem 16.01.2024)
CEO, UBS Fund Management (Luxembourg) S.A.

Kathrin Isch
Managing Director, Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Zürich

Depotbank und Zahlstelle

Credit Suisse (Luxembourg) S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg

Zentrale Verwaltungsstelle

Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator, L-2182 Luxemburg

Anlageverwalter

Credit Suisse Asset Management (Schweiz) Ltd.
Kalandergrasse 4, CH-8045 Zürich

- Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund
(bis zum 11.03.2024)
- Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund

Rechtsberater

Clifford Chance
10, boulevard Grande-Duchesse Charlotte, L-1330 Luxemburg

Vertriebsstelle

Credit Suisse Fund Management S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg

Vertreter in der Schweiz

Credit Suisse Funds AG (bis zum 30.04.2024)
Uetlibergstrasse 231, Postfach, CH-8070 Zürich

UBS Fund Management (Switzerland) AG (seit dem 01.05.2024)
P.O. Box Aeschenvorstadt 1, CH-4002 Basel

Zahlstelle in der Schweiz

Credit Suisse (Schweiz) AG
Paradeplatz 8, CH-8001 Zürich

Vertreter und Zahlstellen ausserhalb von Luxemburg und der Schweiz

Eine vollständige Liste der Vertreter und Zahlstellen ausserhalb von Luxemburg und der Schweiz ist kostenlos am Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Es dürfen keine Zeichnungen entgegengenommen werden, die auf Finanzberichten beruhen. Zeichnungen werden nur auf Basis des aktuellen Prospekts in Verbindung mit den wesentlichen Anlegerinformationen, dem jüngsten Jahresbericht und dem jüngsten Halbjahresbericht entgegengenommen.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise werden in Luxemburg am Sitz der Verwaltungsgesellschaft veröffentlicht. Der Nettoinventarwert wird ausserdem täglich im Internet unter www.credit-suisse.com sowie gegebenenfalls in verschiedenen Zeitungen veröffentlicht.

Anteilhaber können den Prospekt, die Basisinformationsblätter (PRIIPs-BiB), die jüngsten Jahres- und Halbjahresberichte, die Aufstellung der während des Berichtszeitraums eingetretenen Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes und das Verwaltungsreglement kostenlos am Sitz der Verwaltungsgesellschaft oder von den lokalen Vertretern in den Ländern, in denen der Fonds registriert ist, beziehen.



Audit report

To the Unitholders of
CS Investment Funds 14

Our opinion

In our opinion, the accompanying financial statements give a true and fair view of the financial position of CS Investment Funds 14 (the “Fund”) and of each of its sub-funds as at 31 March 2024, and of the results of their operations and changes in their net assets for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements.

What we have audited

The Fund’s financial statements comprise:

- the combined statement of net assets for the Fund and the statement of net assets for each of the sub-funds as at 31 March 2024;
- the combined statement of operations / changes in net assets for the Fund and the statement of operations / changes in net assets for each of the sub-funds for the year then ended;
- the statement of investments in securities for each of the sub-funds as at 31 March 2024; and
- the notes to the financial statements, which include a summary of significant accounting policies.

Basis for opinion

We conducted our audit in accordance with the Law of 23 July 2016 on the audit profession (Law of 23 July 2016) and with International Standards on Auditing (ISAs) as adopted for Luxembourg by the “Commission de Surveillance du Secteur Financier” (CSSF). Our responsibilities under the Law of 23 July 2016 and ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF are further described in the “Responsibilities of the “Réviseur d’entreprises agréé” for the audit of the financial statements” section of our report.

We believe that the audit evidence we have obtained is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion.

We are independent of the Fund in accordance with the International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards, issued by the International Ethics Standards Board for Accountants (IESBA Code) as adopted for Luxembourg by the CSSF together with the ethical requirements that are relevant to our audit of the financial statements. We have fulfilled our other ethical responsibilities under those ethical requirements.

Other information

The Board of Directors of the Management Company is responsible for the other information. The other information comprises the information stated in the annual report but does not include the financial statements and our audit report thereon.

Our opinion on the financial statements does not cover the other information and we do not express any form of assurance conclusion thereon.

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

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



In connection with our audit of the financial statements, our responsibility is to read the other information identified above and, in doing so, consider whether the other information is materially inconsistent with the financial statements or our knowledge obtained in the audit, or otherwise appears to be materially misstated. If, based on the work we have performed, we conclude that there is a material misstatement of this other information, we are required to report that fact. We have nothing to report in this regard.

Responsibilities of the Board of Directors of the Management Company for the financial statements

The Board of Directors of the Management Company is responsible for the preparation and fair presentation of the financial statements in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements, and for such internal control as the Board of Directors of the Management Company determines is necessary to enable the preparation of financial statements that are free from material misstatement, whether due to fraud or error.

In preparing the financial statements, the Board of Directors of the Management Company is responsible for assessing the Fund's and each of its sub-funds' ability to continue as a going concern, disclosing, as applicable, matters related to going concern and using the going concern basis of accounting unless the Board of Directors of the Management Company either intends to liquidate the Fund or close any of its sub-funds or to cease operations, or has no realistic alternative but to do so.

Responsibilities of the “Réviseur d’entreprises agréé” for the audit of the financial statements

The objectives of our audit are to obtain reasonable assurance about whether the financial statements as a whole are free from material misstatement, whether due to fraud or error, and to issue an audit report that includes our opinion. Reasonable assurance is a high level of assurance, but is not a guarantee that an audit conducted in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF will always detect a material misstatement when it exists. Misstatements can arise from fraud or error and are considered material if, individually or in the aggregate, they could reasonably be expected to influence the economic decisions of users taken on the basis of these financial statements.

As part of an audit in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF, we exercise professional judgment and maintain professional scepticism throughout the audit. We also:

- identify and assess the risks of material misstatement of the financial statements, whether due to fraud or error, design and perform audit procedures responsive to those risks, and obtain audit evidence that is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion. The risk of not detecting a material misstatement resulting from fraud is higher than for one resulting from error, as fraud may involve collusion, forgery, intentional omissions, misrepresentations, or the override of internal control;
- obtain an understanding of internal control relevant to the audit in order to design audit procedures that are appropriate in the circumstances, but not for the purpose of expressing an opinion on the effectiveness of the Fund's internal control;
- evaluate the appropriateness of accounting policies used and the reasonableness of accounting estimates and related disclosures made by the Board of Directors of the Management Company;



- conclude on the appropriateness of the Board of Directors of the Management Company's use of the going concern basis of accounting and, based on the audit evidence obtained, whether a material uncertainty exists related to events or conditions that may cast significant doubt on the Fund's or any of its sub-funds' ability to continue as a going concern. If we conclude that a material uncertainty exists, we are required to draw attention in our audit report to the related disclosures in the financial statements or, if such disclosures are inadequate, to modify our opinion. Our conclusions are based on the audit evidence obtained up to the date of our audit report. However, future events or conditions may cause the Fund or any of its sub-funds to cease to continue as a going concern;
- evaluate the overall presentation, structure and content of the financial statements, including the disclosures, and whether the financial statements represent the underlying transactions and events in a manner that achieves fair presentation.

We communicate with those charged with governance regarding, among other matters, the planned scope and timing of the audit and significant audit findings, including any significant deficiencies in internal control that we identify during our audit.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Represented by

Luxembourg, 10 July 2024

Sandra Paulis



Bestätigungsvermerk des Abschlussprüfers

An die Anteilnehmer des
CS Investment Funds 14

Unser Prüfungsurteil

Unserer Ansicht nach vermittelt der beiliegende Jahresabschluss ein getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage des CS Investment Funds 14 (der "Fonds") und seiner einzelnen Subfonds zum 31. März 2024 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögens für das abgeschlossene Jahr gemäß den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften zur Erstellung und Darstellung von Finanzausweisen.

Art und Umfang unserer Prüfungshandlungen

Zum Jahresabschluss gehören:

- die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens des Fonds und die Aufstellung des Nettovermögens der einzelnen Subfonds zum 31. März 2024;
- die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens des Fonds und die Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens der einzelnen Subfonds zum Jahresende;
- die Aufstellung der Wertpapierbestände für jeden Subfonds zum 31. März 2024; sowie
- die Erläuterungen zum Jahresabschluss, zu denen eine Zusammenfassung wichtiger Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze gehört.

Grundlage unserer Einschätzung

Wir haben unsere Prüfung nach dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über die Abschlussprüfung ("Gesetz vom 23. Juli 2016") und nach den internationalen Prüfungsgrundsätzen (ISA) durchgeführt, wie diese für Luxemburg von der "Commission de Surveillance du Secteur Financier" (CSSF) übernommen wurden. Unsere Aufgaben nach dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF übernommenen ISA sind unter dem Abschnitt "Aufgaben des "Réviseur d'entreprises agréé" bei der Prüfung von Abschlüssen" unseres Berichts erläutert.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser eingeschränktes Prüfungsurteil für den Fonds zu dienen.

Wir sind gemäss dem "Ethischen Kodex für Angehörige des Berufsstands" (Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards) des internationalen Rats für die Verabschiedung von Standards zur Berufsethik für Wirtschaftsprüfer (International Ethics Standards Board for Accountants) (IESBA-Kodex), wie dieser von der CSSF für Luxemburg übernommen wurde, sowie gemäss den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Jahresabschlusses relevant sind, vom Fonds unabhängig und sind unserer ethischen Verantwortung nach diesen ethischen Anforderungen nachgekommen.

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

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

Sonstige Angaben

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Angaben umfassen die im Geschäftsbericht enthaltenen Informationen, jedoch ohne den Jahresabschluss und unseren diesbezüglichen Prüfbericht.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Unsere Verantwortung im Rahmen unserer Prüfung des Jahresabschlusses besteht darin, die oben genannten Informationen kritisch zu lesen und etwaige wesentliche Unstimmigkeiten zwischen den sonstigen Informationen und dem Jahresabschluss oder unseren bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen oder wesentliche falsche Angaben zu berücksichtigen. Wenn wir aufgrund unserer Tätigkeit feststellen, dass die sonstigen Informationen wesentliche falsche Angaben enthalten, sind wir verpflichtet, auf diesen Umstand hinzuweisen. Diesbezüglich haben wir nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen, beabsichtigten oder unbeabsichtigten, falschen Darstellungen ist.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft für die Feststellung verantwortlich, ob der Fonds und jeder seiner Subfonds fortbestehen kann, ggf. für die Offenlegung von Angelegenheiten in Zusammenhang mit dem Fortbestehen sowie für die Rechnungslegung auf der Basis des Fortbestehens, es sei denn, der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, den Fonds abzuwickeln oder einen seiner Subfonds aufzulösen, oder muss dies gezwungenermaßen tun.

Verantwortlichkeiten des "Réviseur d'entreprises agréé" bei der Prüfung des Jahresabschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist es, mit hinreichender Sicherheit ein Urteil bilden zu können, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen ist, sei es auf Grund beabsichtigter oder unbeabsichtigter Fehler, und einen Prüfbericht zu erstellen, der unser Urteil enthält. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Bei unserer Prüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISA entscheiden wir nach unserem fachlichen Urteil und bewahren während der gesamten Prüfung eine kritische Grundhaltung. Unsere Prüfung umfasst daneben Folgendes:

- Das Risiko wesentlicher Fehldarstellungen im Abschluss einzuschätzen, sei es auf Grund beabsichtigter oder unbeabsichtigter Fehler, für dieses Risiko Prüfverfahren zu konzipieren und durchzuführen und Prüfungsnachweise zu erlangen, die eine hinreichende und angemessene Grundlage für unser Urteil sind. Das Risiko, dass eine wesentliche Fehldarstellung nicht erkannt wird, wenn diese beabsichtigt ist, ist größer als bei einer unbeabsichtigten Fehldarstellung, da eine beabsichtigte Fehlerdarstellung auch Absprachen, Fälschungen, ein Verschweigen, die Verdrehung von Tatsachen oder das Übergehen der internen Kontrolle beinhalten kann.



- Zu einem Verständnis des internen Kontrollsystems zu gelangen, soweit es für die Prüfung von Bedeutung ist, um unter Berücksichtigung der Rahmenbedingungen geeignete Prüfungsverfahren festzulegen, nicht jedoch, um ein Urteil über die Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Einzuschätzen, ob die angewandten Grundsätze der Rechnungslegung geeignet und Schätzungen und die entsprechenden Angaben des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft angemessen sind.
- Schlussfolgerung zu ziehen, ob die Annahme der Fortführung der Geschäftstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als Grundlage der Rechnungslegung angemessen ist, und aufgrund der erhaltenen Prüfungsnachweise zu erkennen, ob eine erhebliche Unsicherheit hinsichtlich Ereignissen oder Umständen besteht, die Grund zu berechtigten Zweifeln an der Fortführung des Fonds oder seiner Subfonds geben. Kommen wir zu dem Schluss, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, müssen wir in unserem Prüfbericht auf die diesbezüglichen Offenlegungen im Jahresabschluss hinweisen oder, wenn diese Offenlegungen nicht angemessen sind, unser Prüfungsurteil ändern. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Prüfberichts erlangt haben. Zukünftige Ereignisse oder Umstände können jedoch der Fortführung des Fonds oder seiner Subfonds entgegenstehen.
- Die Gesamtdarstellung, die Struktur und den Inhalt des Jahresabschlusses, einschliesslich der Offenlegungen, einzuschätzen und zu prüfen, ob die zugrundeliegenden Transaktionen und Ereignisse im Jahresabschluss so dargestellt sind, dass ein getreues Bild gegeben wird.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, den 10. Juli 2024

Sandra Paulis

Die englische Version des Jahresberichtes war Bestandteil der Prüfung durch den Abschlussprüfer. Daher bezieht sich der Prüfungsvermerk auch nur auf die englische Version. Sämtliche anderssprachigen Versionen wurden unter Verantwortung des Verwaltungsrates der Verwaltungsgesellschaft erstellt.

Nettovermögensaufstellung (in CHF)**31.03.2024****Aktiva**

Wertpapierbestand zum Marktwert	737.362.481,47
Bareinlagen bei Banken und Brokern	21.082.319,56
Forderungen aus Erträgen	4.959.084,82
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten	5.488,61
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	12.498,73
	763.421.873,19

Passiva

Bankverbindlichkeiten und sonstige	1.251,01
Rückstellungen für Aufwendungen	387.052,43
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten	67.644,34
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	267.423,28
	723.371,06

Nettovermögen **762.698.502,13**

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens (in CHF)Für die Periode vom
01.04.2023 bis zum
31.03.2024

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	1.380.523.718,28
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	18.504.494,54
Bankzinsen	278.220,27
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	146.414,86
	18.929.129,67
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	3.566.089,41
Depotbank- und Depotgebühr	620.153,98
Zentralverwaltungsvergütung	584.467,70
Druck- und Veröffentlichungskosten	43.838,79
Zinsen und Bankspesen	3.776,83
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	406.048,21
"Taxe d'abonnement"	242.940,94
	5.467.315,86
Nettoerträge (-verluste)	13.461.813,81
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-27.067.338,38
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-11.971,55
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	-33.049,22
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	575.217,07
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	227.031,72
	-26.310.110,36
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-12.848.296,55
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	59.609.345,82
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	5.488,61
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-517.775,57
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-522.852,19
	58.574.206,67
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	45.725.910,12
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	116.865.501,67
Rücknahmen	-766.755.138,06
	-649.889.636,39
Ausschüttung	-1.091.142,31
Währungsdifferenz	-12.570.347,57
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	762.698.502,13

Allgemeines

CS Investment Funds 14 ("der Fonds") ist ein luxemburgischer Investmentfonds mit Subfonds ("Umbrellafonds"). Der Fonds ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäss den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes vom 17.12.2010 in seiner geänderten Fassung in Luxemburg registriert.

Zum 31.03.2024 hatte der Fonds vier Subfonds aufgelegt.

Änderungen:

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, den Subfonds Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund zum 11. März 2024 zu liquidieren.

Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

a) Darstellung des Abschlusses

Der Abschluss des Fonds wurde gemäß den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen für Organismen für gemeinsame Anlagen nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

b) Berechnung des Nettoinventarwerts des jeweiligen Subfonds

Der Nettoinventarwert der Anteile jedes Subfonds wird in der Referenzwährung des jeweiligen Subfonds berechnet und wird von der Verwaltungsgesellschaft in Luxemburg an jedem Bankarbeitstag, an dem Banken in Luxemburg normalerweise ganztägig für den Geschäftsverkehr geöffnet sind (jeweils ein "Bewertungstag"), ermittelt. Der Nettoinventarwert jedes Subfonds wird jeden Tag auf der Grundlage der bis zu diesem Tag aufgelaufenen Erträge/Aufwendungen und der Bewertung des Nettovermögens auf der Grundlage der zuletzt verfügbaren Marktpreise ermittelt.

Der Abschluss berücksichtigt die Nettoinventarwerte zum 31.03.2024, die auf den Marktpreisen der Anlagen vom 28.03.2024 basieren.

Der Anlageverwalter muss Transaktionen ausführen, um die gewünschte Allokation nach Zeichnungen oder Rücknahmen aufrechtzuerhalten. Hierdurch können zusätzliche Kosten für den Subfonds und die Anteilhaber entstehen. Um die Interessen der vorhandenen Anleger vor solchen Kapitalschwankungen zu schützen, wird daher eine Anpassung des verwendeten NIW pro Anteil vorgenommen, wenn die Netto-Kapitalschwankungen einen vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Grenzwert überschreiten. Diese Anpassung spiegelt die geschätzten Steuern und Handelskosten wider, die dem Subfonds durch diese Transaktionen entstehen können, sowie die geschätzte Geld-Brief-Spanne der Vermögenswerte, in die der Subfonds investiert. Es wird regelmäßig überprüft, ob der angewendete Swing-Faktor angemessen ist.

Der NIW je Anteil, der in den statistischen Informationen angegeben wird, ist der veröffentlichte NIW je Anteil, während das Gesamtvermögen, das in der Aufstellung des Nettovermögens aufgeführt ist, das Gesamtvermögen ohne Swing-Anpassung zum Ende des Jahres ist.

Der Fonds wendet einen partiellen Swing-Price an. Der berechnete Nettoinventarwert wird um bis zu maximal 2% je Anteil erhöht, wenn es zu einem Nettoüberschuss an Zeichnungsanträgen kommt, oder um bis zu maximal 2% pro Anteil verringert, wenn es zu einem Nettoüberschuss an Rücknahmeanträgen kommt. Dies geschieht auf der Grundlage der an dem betreffenden Bewertungstag eingegangenen Anträge.

Zum 31.03.2024 wurde kein Swing-Pricing angewendet.

c) Bewertung des Wertpapierbestands des jeweiligen Subfonds

Wertpapiere, die an einer Wertpapierbörse kotiert sind oder die dort regelmässig gehandelt werden, werden zum zuletzt verfügbaren Handelspreis bewertet. Ist ein solcher Preis für eine bestimmte Börsensitzung nicht verfügbar, jedoch ein mittlerer Marktschlusskurs (der Mittelwert der kotierten letzten Brief- und Geldkurse) oder ein Schlussgeldkurs, kann der mittlere Marktschlusskurs oder alternativ der Schlussgeldkurs als Bewertungsgrundlage herangezogen werden.

Beim Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund werden die Wertpapiere, die an einer Wertpapierbörse kotiert sind oder die dort regelmässig gehandelt werden, zum Geldkurs bewertet. Ist ein solcher Kurs für eine bestimmte Börsensitzung nicht verfügbar, wird die gleiche Bewertung vorgenommen wie bei den anderen Subfonds.

Wenn ein Wertpapier an mehreren Wertpapierbörsen gehandelt wird, erfolgt die Bewertung unter Bezugnahme auf die Börse, an der es vorwiegend gehandelt wird. Im Fall von Wertpapieren, die nur in geringem Masse an einer Wertpapierbörse gehandelt werden, die jedoch unter Wertpapierhändlern an einem Sekundärmarkt mit geregeltem Handel gekauft und verkauft werden (mit dem Effekt, dass der Kurs auf Marktbasis festgesetzt wird), kann sich die Bewertung auf diesen Sekundärmarkt stützen. An einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden auf dieselbe Weise wie an einer Wertpapierbörse kotierte Wertpapiere bewertet.

Wertpapiere, welche nicht an einer Wertpapierbörse kotiert sind oder nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zu ihrem letzten verfügbaren Marktpreis bewertet. Ist ein solcher nicht verfügbar, erfolgt die Bewertung der Wertpapiere durch die Verwaltungsgesellschaft gemäss anderen von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden Kriterien und auf der Grundlage der voraussichtlich möglichen Verkaufspreise. Der Anteil des Nettovermögens eines Short-Term-Subfonds, der aus Wertpapieren mit einer Laufzeit oder Restlaufzeit von weniger als sechs Monaten besteht, kann bewertet werden, indem der Bewertungspreis einer Anlage schrittweise auf Grundlage ihres Nettoerwerbspreises oder ihres Preises zu dem Zeitpunkt, an dem ihre Restlaufzeit kürzer als sechs Monate wurde, an den Rücknahmepreis angepasst und so die resultierende Rendite konstant gehalten wird.

Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen muss die Grundlage für die Bewertung der verschiedenen Anlagen an den neuen Marktrenditen ausgerichtet werden. Sofern eine Bewertung gemäss den vorstehenden Regeln aufgrund besonderer oder geänderter Umstände nicht möglich oder fehlerhaft ist, kann die Verwaltungsgesellschaft für die Bewertung der Wertpapiere andere allgemein anerkannte Bewertungsgrundsätze anwenden. Unter besonderen Umständen können weitere Bewertungen an demselben Tag vorgenommen werden. Diese Bewertungen gelten für jegliche Zeichnungs- und/oder Rücknahmeanträge, die anschliessend eingehen.

d) Guthaben bei Banken und Maklern

Guthaben bei Banken und Maklern umfassen Barbestände, Nachschussforderungen und Sichteinlagen bei Banken sowie Kontokorrentkredite.

e) Realisierte Nettogewinne/-verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren jedes Subfonds

Die aus Verkäufen von Wertpapieren resultierenden realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises berechnet.

f) Währungsumrechnung

Der Abschluss wird in der Referenzwährung der einzelnen Subfonds erstellt, und der konsolidierte Abschluss wird in CHF erstellt.

Guthaben bei Banken, anderes Nettovermögen sowie der Wert von Wertpapieren des Portfolios, die auf andere Währungen lauten als die Referenzwährung des jeweiligen Subfonds, werden zu dem am Bewertungstag geltenden Wechselkurs in die Referenzwährung umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des jeweiligen Subfonds lauten, werden zu dem Wechselkurs, der an dem Tag gilt, an dem sie dem Subfonds entstehen, in die Referenzwährung umgerechnet.

Realisierte Währungsgewinne oder -verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung bzw. den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen.

Der Einstandswert der Wertpapiere in anderen Währungen als der Referenzwährung des jeweiligen Subfonds wird zu dem am Tag des Erwerbs geltenden Wechselkurs in die Referenzwährung umgerechnet.

g) Buchung von Wertpapiertransaktionen der einzelnen Subfonds

Die Wertpapiergeschäfte werden an den Transaktionstagen gebucht.

h) Bewertung von Finanzterminkontrakten der einzelnen Subfonds

Noch nicht fällige Finanzterminkontrakte werden mit den am Bewertungstag gültigen Marktsätzen bewertet, und die daraus resultierenden nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung/Veränderung des Nettovermögens" verbucht und unter "Nicht realisierter Gewinn/Verlust aus Finanzterminkontrakten" in der Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden auch in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung/Veränderung des Nettovermögens" verbucht unter "Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten".

i) Bewertung von Devisenterminkontrakten der einzelnen Subfonds

Noch nicht fällige Devisenterminkontrakte werden mit den am Bewertungstag gültigen Terminwechsellkursen bewertet, und die daraus resultierenden nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung/Veränderung des Nettovermögens" verbucht und unter "Nicht realisierter Gewinn/Verlust aus Devisenterminkontrakten" in der Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden auch in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" verbucht unter "Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten".

j) Bewertung von Swaps

An jedem Bewertungstag werden Swap-Vereinbarungen zum Nettobarwert der künftigen Cashflows anhand der betreffenden Zinsstrukturkurve am Bewertungstag bewertet.

Asset-Swap-Kontrakte und die mit den Asset-Swaps verbundenen Wertpapiere werden nicht neu bewertet, da das Wertpapier und der Asset-Swap für die Zwecke der Bewertung als ein einziges Instrument betrachtet werden.

k) Zuordnung der Aufwendungen

Jedem Subfonds werden die Aufwendungen belastet, die ihm direkt zugerechnet werden können. Nicht direkt zurechenbare Aufwendungen werden proportional zum Nettovermögen der jeweiligen Subfonds zwischen den Subfonds aufgeteilt.

l) Wertpapierleihgeschäfte

Der Fonds kann mit Wertpapieren in den Portfolios seiner Subfonds Wertpapierleihgeschäfte abschliessen. Der Fonds darf Wertpapiere nur im Rahmen eines standardisierten Systems für Wertpapierleihe verleihen, das von einem anerkannten Institut für Wertpapierabrechnung oder von erstklassigen Finanzinstituten, die auf diese Art von Geschäften spezialisiert sind, organisiert wird.

m) Buchung von Erträgen

Dividenden werden zum Ex-Dividendendatum gebucht, nach Abzug der Quellensteuer. Zinsen werden auf täglicher Basis gebucht.

Verwaltungsgebühr

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Zur Vergütung ihrer Dienstleistungen und Erstattung ihrer Kosten hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Verwaltungsgebühr (siehe Einzelheiten auf Subfondsebene), die jeweils am Monatsende zahlbar ist. Berechnungsgrundlage der Gebühr ist der Durchschnitt der täglichen Nettoinventarwerte der jeweiligen Anteilsklasse in dem entsprechenden Monat. Zusätzlich enthält die Verwaltungsgebühr eine Anpassung der Verwaltungsgebühr, die in diesem Geschäftsjahr in Bezug auf das vorherige Geschäftsjahr berechnet wird.

"Taxe d'abonnement"

Nach den geltenden Gesetzen und Vorschriften unterliegt der Fonds in Luxemburg auf Basis seiner Anlagen einer "taxe d'abonnement", die zu einem jährlichen Satz von 0,05% vierteljährlich zahlbar ist. Sie wird anhand des Nettovermögens jedes Subfonds am Ende jedes Quartals berechnet. Im Fall von Anteilsklassen, die nur von institutionellen Anlegern erworben werden dürfen, beträgt der jährliche Satz dieser Steuer 0,01%.

Der Anteil des Nettovermögens, der in andere Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren nach luxemburgischem Recht investiert ist, ist von dieser "taxe d'abonnement" befreit.

Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER)

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die TER entspricht der Summe aller Kosten und Provisionen, die dem Fondsvermögen laufend belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Vermögens.

Die TER wird nach der AMAS-Richtlinie berechnet.

Für Anteile, die während des Berichtsjahres liquidiert wurden, wird keine TER ausgewiesen.

Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

Die Aufstellung aller während des Berichtszeitraums/-jahres eingetretenen Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes kann von den Anteilhabern am Sitz der Verwaltungsgesellschaft oder der lokalen Vertreter in den Ländern, in denen der Fonds registriert ist, kostenlos bezogen werden.

Depotbankgebühr

Die Depotbank erhält vom Fonds die in Luxemburg üblichen Provisionen und Gebühren. Sie setzen sich zusammen aus einer Gebühr, die als Prozentsatz vom Nettovermögen des betreffenden Subfonds berechnet wird, und aus transaktionsgebundenen Provisionen.

Wechselkurse

Der konsolidierte Abschluss wird in CHF erstellt. Zu diesem Zweck wird der Abschluss der einzelnen Subfonds zu den am 31.03.2024 geltenden Wechselkursen in CHF umgerechnet:

1 EUR	= 0,972750	CHF
1 USD	= 0,900694	CHF

Fondsperformance

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die Performance des Jahres N basiert auf den am letzten Geschäftstag des Jahres N bzw. N-1 berechneten Nettoinventarwerten. Diese Nettoinventarwerte spiegeln die Marktpreise der Anlagen am letzten Geschäftstag des Jahres N bzw. N-1 wider. Die Performance seit Jahresbeginn (YTD) bezieht sich auf den Zeitraum vom 01.01.2024 bis zum 31.03.2024.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf gegenwärtige oder künftige Wertentwicklungen.

Bei den Performanceangaben sind bei der Zeichnung und Rücknahme von Fondsanteilen erhobene Kosten und Provisionen nicht berücksichtigt.

Für Anteile, die vor mehr als drei Jahren aufgelegt wurden, wird keine Performance seit Auflegung ausgewiesen.

Die Performance wird auf Basis des NIW je Anteil nach Anwendung von Swing-Pricing berechnet.

Risikomanagement

Das Gesamtrisiko der Subfonds wird nach dem Commitment-Ansatz berechnet.

Transaktionskosten

Transaktionskosten beinhalten Brokergebühren, Stempelsteuern, lokale Steuern und andere ausländische Gebühren, die im Berichtszeitraum/Berichtsjahr entstanden sind. Die Transaktionskosten sind in den Kosten der gekauften und verkauften Wertpapiere enthalten.

In dem am 31.03.2024 abgeschlossenen Jahr entstanden dem Fonds folgende Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Kauf oder Verkauf von Wertpapieren und ähnlichen Geschäften (einschliesslich derivativer Finanzinstrumente oder anderer zulässiger Vermögenswerte):

Subfonds	Währung	Transaktionskosten
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	0,00
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	0,00
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	166,50
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund (bis zum 11.03.2024)	CHF	0,00
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	0,00

Nicht alle Transaktionskosten sind einzeln identifizierbar. Bei festverzinslichen Anlagen, Devisenterminkontrakten und einigen anderen Derivatekontrakten sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Obwohl sie nicht einzeln identifizierbar sind, werden diese Transaktionskosten in der Performance der einzelnen Subfonds erfasst.

Wertpapierleihe

Die Subfonds partizipierten am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich wie folgt:

Subfonds	Währung	Marktwert der Wertpapierleihe	Marktwert der Sicherheiten
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	9.947.311,00	10.463.642,76
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	3.164.373,00	3.328.625,06
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	4.899.643,00	5.153.967,14
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	1.869.369,00	1.966.407,71

Die von der Gegenpartei des Wertpapierleihgeschäfts für den Fonds gestellten Sicherheiten setzen sich zusammen aus einem gut diversifizierten Wertpapierportfolio, bestehend aus

- Anleihen mit hohem Rating, die von einem Staat, von staatlichen Behörden, öffentlich-rechtlichen Einrichtungen oder Unternehmen (ausser verbundene Unternehmen von Credit Suisse) aus den OECD-Ländern begeben oder garantiert wurden;
- Anleihen mit hohem Rating von supranationalen Organisationen;
- Aktien, die an ausgewählten Wertpapierbörsen innerhalb der OECD kotiert sind, unter der Voraussetzung, dass die Anteile in einem liquiden Hauptindex enthalten sind.

Bei der Bestimmung des Marktwerts der Sicherheiten werden angemessene "Haircuts" angewendet, die an die Volatilität der Art der Sicherheit angepasst sind. Die Erlöse, die in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" unter "Erträge aus Wertpapierleihe" ausgewiesen sind, sind die vom Wertpapierleihe-Principal erhaltenen Nettobeträge. Alle direkten und indirekten betrieblichen Kosten und Gebühren werden aus seinen Gebühren getragen und umfassen das vom Principal getragene Haftungsrisiko.

Für das Jahr bis zum 31.03.2024 belief sich die an den Principal gezahlte Gebühr auf folgende Beträge:

Subfonds	Währung	Bruttobetrag Wertpapierleihe	Aufwendungen und Provisionen von der Gegenpartei der Wertpapierleihgeschäfte	Nettobetrag des Ertrags aus Wertpapierleihe
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	83.107,01	17.881,32	65.225,69
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	19.752,02	4.164,97	15.587,05
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	70.223,01	14.426,23	55.796,78
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund (bis zum 11.03.2024)	CHF	3.351,71	733,16	2.618,55
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	18.614,07	4.108,95	14.505,12

Derivative Finanzinstrumente

Der Subfonds kann Derivategeschäfte zum Zweck der effizienten Portfolioverwaltung tätigen.

Zum 31.03.2024 hatte der Fonds keine Sicherheiten angenommen, um das Gegenparteirisiko zu mindern.

Barsicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die in den Guthaben bei Banken und Maklern in der Aufstellung des Nettovermögens enthalten sind:

Subfonds	Art	Gegenpartei	Währung	Betrag
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	Barmittel	JP Morgan Chicago	CHF	395.000,00
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	Barmittel	JP Morgan Chicago	CHF	195.000,00

Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen

Informationen über ökologische und/oder soziale Merkmale und/oder nachhaltige Investitionen sind in den entsprechenden (ungeprüften) Anhängen zur Transparenz hinsichtlich der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und nachhaltiger Investitionen zu finden.

Krieg in der Ukraine

Als Reaktion auf den seit Ende Februar 2022 herrschenden Krieg in der Ukraine haben die USA, die EU, das Vereinigte Königreich, die Schweiz und andere Länder weltweit strenge Sanktionen gegen das russische Finanzsystem sowie gegen russische Regierungsbeamte und Wirtschaftsführer verhängt. Die Sanktionen umfassen Beschränkungen für den Zugang russischer Banken zum Finanznachrichtendienst SWIFT sowie Einschränkungen in Bezug auf Transaktionen mit der russischen Zentralbank. Die russische Regierung hat ebenfalls bestimmte Gegenmassnahmen verhängt, zu denen Beschränkungen in Bezug auf Fremdwährungskonten und Wertpapiergeschäfte gehören.

Die Gesellschaft prüft laufend die Auswirkungen der bereits verhängten Sanktionen sowie möglicher künftiger Verschärfungen auf ihr Geschäft. Die jüngsten Entwicklungen wirkten sich erheblich auf die unmittelbar betroffenen Vermögenswerte aus, die von Investmentfonds von CSAM gehalten werden. Wir beobachten die Lage genau und lassen aktuelle Informationen über die Marktliquidität und die Handelbarkeit von unmittelbar betroffenen Vermögenswerten in deren Bewertung einfließen. Das wichtigste Ziel unseres Bewertungsansatzes besteht im Schutz der Interessen unserer Anleger.

Bedeutende Ereignisse während des Jahres

Der neue Verkaufsprospekt trat im Mai 2023 in Kraft.

Am 12. Juni 2023 wurde die Credit Suisse Group AG mit der UBS Group AG fusioniert. Das konsolidierte Unternehmen fungiert nun als konsolidierte Bankengruppe (die "Fusion"). Der Fonds bezieht verschiedene Dienstleistungen und unterhält Bankbeziehungen zu konsolidierten Tochtergesellschaften der Credit Suisse Group AG. Diese Beziehungen und Dienstleister können sich in der Zukunft infolge der Fusion ändern.

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Ungeachtet der Tatsache, dass die Fortführung der Geschäftstätigkeit des Fonds angenommen wird, wird angesichts der Tatsache, dass nur noch vier Subfonds im Fonds verbleiben, die Zukunft des Fonds überprüft.

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund

In den letzten zwölf Monaten stiegen die Zinsen weltweit weiter an. Die meisten großen Zentralbanken beendeten ihre Straffungszyklen, und gegen Ende des Jahres begannen die Märkte, den Zeitpunkt der ersten Zinssenkungen zu antizipieren. Die kurzfristigen Zinsen im Euroraum waren relativ stabil: die Rendite der zweijährigen deutschen Bundesanleihe bewegte sich im Berichtszeitraum in einer Bandbreite zwischen 2,5 % und 3,3 %. Dies spiegelt die schwächere Konjunktur im Euroraum im Vergleich zu den USA wider, wo die kurzfristigen Zinsen in den letzten zwölf Monaten stärker gestiegen sind. Die Kreditspreads haben sich auf dem Euro-Markt deutlich verengt, insbesondere seit Oktober 2023.

Der Fonds behielt im Berichtszeitraum eine kleine Short-Durationspositionierung bei und war in BBB-Anleihen gegenüber Anleihen mit A-Rating übergewichtet, allerdings mit einer geringeren durchschnittlichen Restlaufzeit. Angesichts der inversen Zinsstrukturkurve profitierte diese Strategie von den attraktiven Renditeniveaus am vorderen Ende der Zinsstrukturkurve und war der Hauptfaktor für die Brutto-Outperformance gegenüber der Benchmark im Berichtszeitraum. Darüber hinaus wurde das Engagement in Kreditwerten im letzten Quartal 2023 leicht erhöht, was ebenfalls zur Brutto-Outperformance beitrug.

Informationen über die durch den Subfonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund

Die Phase wiederholter Zinserhöhungen durch die Zentralbanken endete im Sommer 2023, als die Inflation weltweit zu sinken begann. In mehreren Regionen (z. B. Asien und Europa) verlangsamte sich das Wachstum, während sich die US-Wirtschaft trotz eines Leitzinses von 5,5 % im Juli als widerstandsfähig erwies. Die Kreditspreads weiteten sich leicht aus, da die Unsicherheit über die künftige Wirtschaftsentwicklung und die höheren kurzfristigen Zinsen die Attraktivität sicherer Anlagen erhöhten.

Im Herbst 2023 kam es zu zwei bemerkenswerten Ereignissen. Zum einen griff die Hamas Israel aus dem Gaza-Streifen heraus an. Zum anderen setzten die Märkte kurz darauf zu einer Rally an, die bis zum Ende des ersten Quartals 2024 anhielt. Die sinkende Inflation und die positiven Wachstumsraten schürten die Erwartungen der Märkte auf eine so genannte „sanfte Landung“ der Wirtschaft. Die Zinssätze der Zentralbanken blieben unverändert („über einen längeren Zeitraum erhöht“), da die Inflation über dem Zielwert blieb. Die einzige Ausnahme bildete die Schweiz, wo die SNB im März 2024 eine erste Zinssenkung (um 25 Basispunkte) vornahm.

Im Frühjahr 2023 war die Duration aufgrund der Erwartung steigender Zinsen im Vergleich zur Benchmark kurz. Als der Druck durch die höheren Zinssätze nachließ, wurde die Duration im Mai auf neutral erhöht, bevor sie im November aufgrund des Zinsanstiegs wieder verkürzt wurde. Zum Ende des Berichtszeitraums war die Duration aufgrund der weiterhin inversen Zinsstrukturkurve im Vergleich zur Benchmark erneut kurz. Das Portfolio blieb das ganze Jahr über in Emittenten aus dem Finanz- und Industriesektor übergewichtet, während es in konservativeren und renditeschwächeren Sektoren wie Agency-Titeln und Covered Bonds untergewichtet blieb.

Geografisch lag der Schwerpunkt erneut auf europäischen Emittenten, die aufgrund des langsameren Wachstums in Europa mit einem Aufschlag gegenüber ihren US-Pendants gehandelt wurden. Die Positionen in USD- und EUR-Anleihen reduzierten wir weiter, da die hohen Kosten für die Währungsabsicherung ihre Attraktivität schmälerten.

Informationen über die durch den Subfonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund

In den letzten zwölf Monaten stiegen die Zinsen weltweit weiter an. Die meisten großen Zentralbanken beendeten ihre Straffungszyklen, und gegen Ende des Jahres begannen die Märkte, den Zeitpunkt der ersten Zinssenkungen zu antizipieren. Aufgrund der anhaltenden Widerstandsfähigkeit der US-Wirtschaft und einer weiterhin über dem Zielwert liegenden Inflationsrate beließ die US-Notenbank das Zielband für den Leitzins im Januar und März 2024 unverändert bei 5,25 % bis 5,5 %. Der Ausschuss betonte, dass er trotz der bisherigen Fortschritte bei der Inflationsbekämpfung noch nicht zuversichtlich genug sei, um den Leitzins zu senken. Dies hatte einen Anstieg der Zinsen zur Folge, und die Erwartung von Zinssenkungen wurde von den Marktteilnehmern immer weiter in die Zukunft verschoben.

Der Fonds behielt im Berichtszeitraum eine kleine Short-Durationspositionierung bei, die einen positiven Beitrag zur Brutto-Outperformance des Fonds gegenüber seiner Benchmark leistete. Der Fonds war in BBB-Anleihen gegenüber Anleihen mit A-Rating übergewichtet, allerdings mit einer geringeren durchschnittlichen Restlaufzeit. Angesichts der inversen Zinsstrukturkurve profitierte diese Strategie von den attraktiven Renditeniveaus am vorderen Ende der Zinsstrukturkurve und war der Hauptfaktor für die Outperformance gegenüber der Benchmark im Berichtszeitraum.

Informationen über die durch den Subfonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund (bis zum 11.03.2024)

In den letzten zwölf Monaten stiegen die Zinsen weltweit weiter an, während die Rezessionserwartungen in den USA zurückgingen. Die meisten großen Zentralbanken beendeten ihre Straffungszyklen, und die Märkte begannen, den Zeitpunkt der ersten Zinssenkungen zu antizipieren. Sowohl die nominalen als auch die realen 10-jährigen US-Zinssätze stiegen um 70 Basispunkte, während die Inflations-Break-Events den Berichtszeitraum unverändert beendeten. Die US-Notenbank beließ das Zielband für den Leitzins im Januar und März unverändert bei 5,25 % bis 5,5 % und betonte, dass sie trotz der bisherigen Fortschritte bei der Inflationsbekämpfung noch nicht zuversichtlich genug sei, um den Leitzins zu senken.

Der Fonds behielt während des größten Teils des Berichtszeitraums eine kurze Realzinsduration bei, wobei die Short-Position im Oktober 2023 erhöht wurde. Dies wirkte sich angesichts des starken Anstiegs der Realzinsen negativ auf die Performance aus. Der Fonds war in Covered Bonds zugunsten von Unternehmensanleihen leicht untergewichtet, was sich aufgrund der Outperformance der risikoreicheren Segmente des Kreditmarktes positiv auswirkte. Den größten negativen Einfluss auf die Performance hatte die Inflationsabsicherung, da die Breakeven-Inflationsraten in den letzten zwölf Monaten im USD-Raum um ca. 0,1 % und in der Eurozone um 0,4 % gesunken sind (fünfjährige Laufzeiten).

Informationen über die durch den Subfonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund

Das Jahr 2023 war geprägt von weltweit rasant steigenden Leitzinsen, Bankenrisiken in den USA und der Schweiz, exogenen Faktoren wie dem Krieg in der Ukraine und mit Israel im Gazastreifen sowie der Immobilienkrise in China. Die aufgrund der hartnäckig hohen Inflation eingeleitete restriktive Geldpolitik blieb bis in die zweite Hälfte des Jahres 2023 bestehen. Die einzelnen Wirtschaftsräume entwickelten sich weiterhin sehr unterschiedlich. So verzeichnete die US-Wirtschaft erneut ein robustes Wachstum, während das Wachstum in vielen anderen Ländern erhalten blieb. Die schwache Dynamik der globalen Industrie und das geringe Wachstum in Deutschland belasteten den Euroraum. Die weltweite Konjunkturabschwächung belastete auch die Schweizer Wirtschaft. Das Schweizer Bruttoinlandsprodukt (BIP) wuchs im vierten Quartal des vergangenen Jahres moderat um 0,3 % (+0,6 % gegenüber dem Vorjahr, +1,3 % im Gesamtjahr 2023).

Das Geschehen an den internationalen Finanzmärkten war auch im Jahr 2023 von der Entwicklung der Inflation und der geldpolitischen Erwartungen geprägt. Viele Zentralbanken verzichteten im vierten Quartal auf weitere Zinserhöhungen. Die geldpolitischen Signale führten zu einer regelrechten Rally bei zehnjährigen Staatsanleihen sowie zu einer deutlichen Abflachung und noch stärkeren Inversion der Zinsstrukturkurven. Der Schweizer Franken wertete massiv auf und erreichte gegenüber dem Euro neue Höchststände.

Die schwächer werdenden Konjunkturindikatoren und der nachlassende Inflationsdruck deuten nun auf ein Ende des Zinszyklus hin. Ab November trugen überraschend niedrige Inflationsdaten im Euroraum und in den USA dazu bei, dass die Marktteilnehmer eine frühere Lockerung der Geldpolitik in den großen Währungsräumen erwarteten. Das erste Quartal 2024 ist nun geprägt von sinkenden Inflationszahlen und der Hoffnung auf sinkende Zinsen. Die Weltwirtschaft expandierte im vierten Quartal 2023 moderat. Nachdem die Inflation im Laufe des Jahres 2023 vielerorts rasch zurückgegangen war, hat sich der Rückgang in den letzten Monaten etwas verlangsamt. In vielen Ländern liegt die Inflation immer noch über dem Zielwert der Zentralbanken. Nach der jüngsten Serie positiver Konjunkturüberraschungen haben sich die zuvor sehr positiven Zins- und Inflationserwartungen wieder etwas normalisiert. Für 2024 sind nur noch halb so viele Zinssenkungen der Fed und der EZB eingepreist wie zu Jahresbeginn.

Während die SNB den Leitzins im Jahr 2023 in drei Schritten um insgesamt +75 Basispunkte anhebte, überraschte sie die Märkte auf ihrer Sitzung im März 2024 mit einer unerwartet frühen Zinssenkung um -25 Basispunkte auf 1,5 %. Sie revidierte ihre Inflationsprognose erneut und korrigierte sie deutlich nach unten. Befürchtungen, dass es zu stärkeren Zweitrundeeffekten kommen könnte, scheinen sich in Luft aufgelöst zu haben.

Im Berichtszeitraum sanken die Zinsen für Schweizer Staatsanleihen am vorderen Ende der Kurve um bis zu -88 Basispunkte. Die Zinsstrukturkurve verlagerte sich nach unten und wurde noch inverser. Die Inversion zwischen 2-jährigen und 10-jährigen Schweizer Renditen erreichte gegen Ende 2023 einen absoluten Rekord von -50 Basispunkten. Gleiches galt für 10- und 30-jährige Laufzeiten mit einer Differenz von -35 Basispunkten. Die Rendite der 10-jährigen Benchmarkanleihe schwankte zwischen 0,59 % und 1,31 % und lag zum Ende des Berichtszeitraums um -56 Basispunkte niedriger bei 0,69 %. Damit gehörten 10-jährige Schweizer Staatsanleihen erneut zu den Spitzenreitern unter vergleichbaren globalen Staatsanleihen. Die Swap-Spreads engten sich vor allem am kurzen Ende massiv ein, während sich die Kreditspreads ausweiteten.

In diesem Umfeld wurde die Duration zunächst wieder etwas erhöht und die starke Untergewichtung der langen Laufzeiten reduziert. Angesichts der starken Inversion gegen Ende 2023 wurde das Zinsrisiko in Erwartung einer Normalisierung wieder deutlich reduziert. Die Laufzeit wurde verkürzt, um vom Carry am vorderen Ende der Kurve zu profitieren. Mit einer deutlichen Übergewichtung des Finanzsektors zu Lasten von Covered Bonds und supranationalen Anleihen profitierte der Fonds von der Verengung der Swap-Spreads.

Informationen über die durch den Subfonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	EUR	1498937	LU0155950867	0,60%	0,83%
B - Thesaurierend	EUR	1498940	LU0155951089	0,60%	0,83%
DB - Thesaurierend	EUR	1571278	LU0164804014	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	EUR	23527497	LU1024300342	0,25%	0,44%
EB - Thesaurierend	EUR	11660344	LU0535913296	0,25%	0,44%
IB - Thesaurierend	EUR	1498943	LU0155951329	0,30%	0,52%
MB - Thesaurierend	EUR	14990630	LU0747630571	0,20%	/
UA - Ausschüttend	EUR	26362610	LU1144399323	0,45%	0,68%
UB - Thesaurierend	EUR	26362631	LU1144399596	0,45%	0,68%

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die -DB- Aktien.

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund -MB- EUR wurde am 13.12.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	EUR	0,47%	/	4,47%	-6,77%	-0,60%
B - Thesaurierend	EUR	0,48%	/	4,46%	-6,77%	-0,59%
DB - Thesaurierend	EUR	0,66%	/	5,21%	-6,12%	0,09%
EA - Ausschüttend	EUR	0,57%	/	4,88%	-6,41%	-0,21%
EB - Thesaurierend	EUR	0,57%	/	4,88%	-6,41%	-0,21%
IB - Thesaurierend	EUR	0,55%	/	4,78%	-6,49%	-0,30%
MB - Thesaurierend	EUR	/	/	/	-6,36%	-0,16%
UA - Ausschüttend	EUR	0,52%	/	4,63%	-6,64%	-0,44%
UB - Thesaurierend	EUR	0,52%	/	4,63%	-6,64%	-0,44%

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	EUR	16.05.2023	0,71
EA - Ausschüttend	EUR	16.05.2023	11,24
UA - Ausschüttend	EUR	16.05.2023	0,92

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
<i>Gegenpartei</i>					
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	5.734.727	USD	-6.220.000	23.05.2024	-11.129,62
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.900.000	EUR	-1.745.674	23.05.2024	9.483,67
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-1.645,95

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

		31.03.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		153.645.647,28			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.365.627,22			
Forderungen aus Erträgen		1.277.573,52			
		157.288.848,02			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		73.996,24			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		1.645,95			
		75.642,19			
Nettovermögen		157.213.205,83			
Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022	
Fondsvermögen	EUR	157.213.205,83	387.427.839,52	480.738.448,62	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	EUR	76,39	74,05	77,29	
B - Thesaurierend	EUR	127,67	122,58	126,40	
DB - Thesaurierend	EUR	1.028,57	980,61	1.004,11	
EA - Ausschüttend	EUR	861,04	834,69	871,30	
EB - Thesaurierend	EUR	1.062,76	1.016,42	1.044,12	
IB - Thesaurierend	EUR	1.044,17	999,53	1.027,67	
MB - Thesaurierend	EUR	/	960,21	985,88	
UA - Ausschüttend	EUR	85,81	83,18	86,81	
UB - Thesaurierend	EUR	99,43	95,32	98,15	
Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	EUR	86.217,373	89.589,827	5.012,692	8.385,146
B - Thesaurierend	EUR	264.747,751	359.662,578	6.583,624	101.498,451
DB - Thesaurierend	EUR	34.242,836	45.582,615	28.982,254	40.322,033
EA - Ausschüttend	EUR	872,842	4.139,032	168,086	3.434,276
EB - Thesaurierend	EUR	64.793,166	145.092,433	13.147,110	93.446,377
IB - Thesaurierend	EUR	6.274,403	21.762,274	0,003	15.487,874
MB - Thesaurierend	EUR	0,000	113.178,659	0,000	113.178,659
UA - Ausschüttend	EUR	12.423,534	17.954,534	372,000	5.903,000
UB - Thesaurierend	EUR	44.023,400	96.089,096	0,000	52.065,696

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in EUR)Für die Periode vom
01.04.2023 bis zum
31.03.2024

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	387.427.839,52
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	4.867.283,32
Bankzinsen	32.513,59
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	65.225,69
	4.965.022,60
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	717.431,79
Depotbank- und Depotgebühr	149.354,24
Zentralverwaltungsvergütung	149.720,77
Druck- und Veröffentlichungskosten	10.716,91
Zinsen und Bankspesen	1.544,48
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	98.434,66
"Taxe d'abonnement"	40.326,54
	1.167.529,39
Nettoerträge (-verluste)	3.797.493,21
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-9.398.250,05
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-58.927,68
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-71.119,95
	-9.528.297,68
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-5.730.804,47
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	16.625.329,50
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-118.453,48
	16.506.876,02
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	10.776.071,55
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	43.975.055,56
Rücknahmen	-284.840.998,72
	-240.865.943,16
Ausschüttung	-124.762,08
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	157.213.205,83

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Niederlande	15,55
Vereinigte Staaten	15,30
Frankreich	13,04
Deutschland	11,63
Grossbritannien	10,10
Dänemark	4,79
Spanien	3,14
Japan	2,83
Italien	2,59
Luxemburg	2,53
Österreich	2,42
Irland	2,33
Schweden	2,18
Norwegen	1,60
Belgien	1,43
Supranational	1,42
Vereinigte Arabische Emirate	1,37
Australien	1,19
Peru	1,19
Schweiz	1,11
Total	97,73

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	44,14
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	24,52
Länder und Zentralregierungen	3,75
Petroleum	3,56
Energie- und Wasserversorgung	3,49
Grafikverlags- und Druckmedien	2,83
Elektrische Geräte und Komponenten	2,37
Fahrzeuge	2,33
Tabak und alkoholische Getränke	1,92
Supranationale Organisationen	1,42
Chemie	1,39
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	1,38
Telekommunikation	1,21
Elektronik und Halbleiter	0,88
Gesundheits- und Sozialdienste	0,85
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	0,61
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	0,55
Verpackungsindustrie	0,54
Total	97,73

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
EUR ABN AMRO BANK NV 4%/23-160128	1.900.000	1.931.217,00	1,23
USD AFRICA FINANCE CORP 3.125%/20-16.06.2025	2.500.000	2.229.814,81	1,42
EUR AMCO SPA 2.25%/20-17.07.2027	1.400.000	1.331.274,00	0,85
EUR ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.625%/19-110326	1.900.000	1.830.802,00	1,16
EUR ASAHI GROUP HOLDINGS 1.151%/17-190925	1.900.000	1.832.455,00	1,17
EUR AT&T 3.5%/13-17.12.2025	1.900.000	1.896.466,00	1,21
EUR BANCO SANTANDER SA 1.375%/20-050126	1.400.000	1.347.542,00	0,86
EUR BANCO SANTANDER SA 3.75%/23-160126	1.400.000	1.405.838,00	0,89
EUR BANK OF AMERICA FIX-TO-FLOATER 1.776%/17-04.05.2027	1.900.000	1.828.978,00	1,16
EUR BANK OF AMERICA S 886 FF FRN/22-271026	900.000	876.375,00	0,56
EUR BANK OF IRELAND FF FRN/22-050626	1.900.000	1.856.205,00	1,18
EUR BARCLAYS FF 1.375%/18-240126	900.000	882.027,00	0,56
EUR BARCLAYS PLC FF FRN/22-310127	2.300.000	2.265.477,00	1,44
EUR BAYER AG 0.75%/20-060127	900.000	828.378,00	0,53
EUR BERRY GLOBAL INC 1%/20-15.01.2025	900.000	878.915,00	0,56
EUR BEVCO LUX SARL 1.5%/20-16.09.2027	2.300.000	2.131.939,00	1,36
EUR BNP PARIBAS FF FRN/19-230127	2.300.000	2.236.014,00	1,42
EUR BNP PARIBAS FF FRN/21-130427	1.400.000	1.305.570,00	0,83
EUR BP CAPITAL MARKETS 2.213%/14-25.09.2026	900.000	879.615,00	0,56
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	1.900.000	1.853.393,00	1,18
EUR BPCE SA 1.375%/18-23.03.2026	1.900.000	1.819.497,00	1,16
EUR CAIXABANK SA 1.375%/19-190626	2.300.000	2.187.576,00	1,39
EUR CARLSBERG BREWERIES A/S 4%/23-051028	1.150.000	1.182.039,00	0,75
EUR CEFPI FINANCE IRELAND DAC 0%/21-060925	1.900.000	1.803.613,00	1,15
EUR CITIGROUP INC FF FRN/18-240726	900.000	874.557,00	0,56
EUR CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/19-08.10.2027	1.400.000	1.297.450,00	0,83
EUR CNH INDUSTRIAL FIN EUR S 1.875%/190126	1.900.000	1.842.373,00	1,17
EUR COCA-COLA HBC FIN 2.75%/22-230925	2.050.000	2.024.600,50	1,29
EUR COMMERZBANK AG S 939 FF FRN/22-140927	1.900.000	1.858.618,00	1,18
EUR COMMONWEALTH BK AUSTR FF 17-031029	1.900.000	1.871.956,00	1,19
EUR COOPERATIVE RABOBK UA 3.913%/23-031126	1.400.000	1.421.826,00	0,90
EUR CREDIT AGRICOLE SA FF FRN/22-121026	900.000	903.483,00	0,57
EUR CREDIT AGRICOLE SA FF FRN/22-220427	2.800.000	2.703.036,00	1,73
EUR DANSKE BANK A/S FF FRN/22-170227	2.300.000	2.199.030,00	1,40
EUR DEUTSCHE BAHN FIN GMBH SUB FF FRN/19-PER	1.900.000	1.832.569,00	1,17
EUR DEUTSCHE BANK AG FF FRN/20-191125	2.300.000	2.256.783,00	1,44
EUR DISCOVERY COMMUNICATIONS 1.9%/15-190327	2.300.000	2.200.387,00	1,40
EUR DNB BANK ASA FF FRN/22-310526	1.650.000	1.611.274,50	1,02
EUR DNB BANK ASA FF FRN/23-160227	900.000	899.433,00	0,57
EUR E.ON SE 1%/20-07.10.2025	1.400.000	1.352.246,00	0,86
EUR EDP FINANCE BV 0.375%/19-160926	1.900.000	1.766.126,00	1,12
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	1.400.000	1.392.342,00	0,89
EUR ENEL FINANCE INTL 0.25%/22-171125	2.800.000	2.654.008,00	1,69
EUR ENGIE SA 1.375%/20-270325	2.800.000	2.739.912,00	1,74
EUR ENI SPA SUB FF FRN/20-PERPET	1.900.000	1.844.596,00	1,17
EUR EUROCLEAR BANK SA 0.125%/20-07.07.2025	1.400.000	1.342.026,00	0,85
EUR FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 3.875%/20-05.01.2026	1.400.000	1.408.204,00	0,90
EUR FIRST ABU DHABI BANK PJS 0.125%/21-16.02.2026	2.300.000	2.149.304,00	1,37
EUR GENERAL ELECTRIC CO 0.875%/17-170525	1.900.000	1.842.791,00	1,17
EUR GENERAL MOTORS FINL CO 0.85%/20-26.02.2026	1.900.000	1.805.076,00	1,15
EUR GERMANY 0%/16-150826	1.000.000	940.200,00	0,60
EUR GERMANY 0.25%/17-150227	3.300.000	3.095.086,50	1,97
EUR GSK CONSUMER HEALTHCARE 1.25%/22-290326	1.400.000	1.340.318,00	0,85
EUR HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/22-150627	1.900.000	1.872.070,00	1,19
EUR IBERDROLA INTL BV (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	1.900.000	1.882.273,00	1,20
EUR INFINEON TECHNO AG SUB FF FRN/19-PERPET	1.400.000	1.379.014,00	0,88
EUR INFORMA PLC 2.125%/20-061025	2.300.000	2.243.949,00	1,43
EUR ING GROEP NV FF FRN/22-160227	1.900.000	1.812.828,00	1,15
EUR ING GROUP (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 17-26.09.2029	900.000	888.129,00	0,56
EUR JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/19-11.03.2027	2.800.000	2.668.512,00	1,70
EUR JYSKE BANK A/S 5.5%/22-161127	1.900.000	1.978.261,00	1,26
EUR KBC GROUP NV S 600035 FF FRN/23-060626	900.000	906.426,00	0,58
EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN/20-010426	1.400.000	1.395.772,00	0,89
EUR MET LIFE GLOB I S 2022-11 1.75%/22-25052	1.400.000	1.368.682,00	0,87
EUR MITSUBISHI UFJ FIN GRP FF FRN/21-080627	2.800.000	2.610.328,00	1,66
EUR MORGAN STANLEY FF FRN/21-291027	2.800.000	2.596.584,00	1,65
EUR MORGAN STANLEY FF FRN/22-080526	900.000	883.116,00	0,56
EUR NATWEST MARKETS PLC 0.125%/21-121125	2.300.000	2.173.638,00	1,38
EUR NYKREDIT REALKREDIT AS 0.25%/20-13.01.2026	2.300.000	2.166.876,00	1,38
EUR OMV AG SUB FF FRN/18-PERPET	1.900.000	1.892.324,00	1,20
USD PROSUS N.V. 3.257%/22-190127	1.000.000	859.305,56	0,55
EUR PROSUS NV 1.207%/22-190126	1.900.000	1.812.315,00	1,15
EUR RAIFFEISEN BANK INTL FF FRN/23-260127	1.900.000	1.916.948,00	1,22
EUR RCI BANQUE SA 4.625%/23-021026	850.000	864.892,00	0,55
EUR RCI BANQUE SA 4.875%/23-140628	1.400.000	1.455.020,00	0,93
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE FIX-TO-FRN (REG. -S-) (SUBORDINATED) 15-25.03.2075	1.400.000	1.399.846,00	0,89
EUR REPUBLIC OF PERU 2.75%/15-30.01.2026	1.900.000	1.867.852,00	1,19
EUR ROYAL FRIESLANDCAMPINA SUB FF FRN/20-PER 2.85%/20-10.12.2169	1.000.000	959.990,00	0,61
EUR SANOFI 0.875%/22-060425	1.400.000	1.362.732,00	0,87
EUR SCHAEFFLER AG 4.5%/24-140826	1.400.000	1.413.818,00	0,90

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen. Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettvermö- gens
EUR SIKA CAPITAL BV 3.75%/23-031126	400.000	403.344,00	0,26
USD SILGAN HOLDINGS INC 1.4%/21-01.04.2026	1.000.000	849.907,41	0,54
EUR SOCIETE GENERALE FF FRN/20-210426	1.900.000	1.845.660,00	1,17
EUR SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.125%/031126	900.000	829.404,00	0,53
EUR SWEDBANK AB FF FRN/21-200527	1.900.000	1.768.292,00	1,12
EUR SYNGENTA FINANCE NV 3.375%/20-160426	1.900.000	1.875.946,00	1,19
EUR TOTAL REG S FF 2.625%/15-PERPET	1.900.000	1.866.674,00	1,19
EUR UBS GROUP AG FF FRN/20-290126	1.800.000	1.745.856,00	1,11
EUR UNICREDIT SPA FF FRN/19-250625	900.000	894.249,00	0,57
EUR VOLKSWAGEN LEASING GMBH 3.625%/24-111026	1.400.000	1.399.804,00	0,89
EUR VOLKSWAGEN LEASING GMBH 4.5%/23-250326	1.900.000	1.929.488,00	1,23
EUR VOLVO TREASURY AB 0%/21-180526	900.000	835.965,00	0,53
EUR WELLS FARGO & COMPANY FIX-TO-FRN FRN/20-04.05.2025	900.000	897.903,00	0,57
EUR WELLS FARGO 1%16-020227	1.400.000	1.304.478,00	0,83
EUR WPP FINANCE 1.375%/18-200325	500.000	488.545,00	0,31
Total Anleihen		153.645.647,28	97,73
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		153.645.647,28	97,73
Total des Wertpapierbestandes		153.645.647,28	97,73
Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.365.627,22	1,50
Andere Nettvermögenswerte		1.201.931,33	0,77
Fondsvermögen		157.213.205,83	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettfondvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	CHF	1498944	LU0155951675	0,50%	0,72%
B - Thesaurierend	CHF	1498946	LU0155952053	0,50%	0,72%
DB - Thesaurierend	CHF	31017122	LU1344630402	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	CHF	23529637	LU1024300938	0,20%	0,37%
EB - Thesaurierend	CHF	11660395	LU0535913619	0,20%	0,39%
IB - Thesaurierend	CHF	1498948	LU0155952566	0,22%	0,45%
UA - Ausschüttend	CHF	26364770	LU1144399679	0,30%	0,52%
UB - Thesaurierend	CHF	26364961	LU1144399752	0,30%	0,52%

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die -DB- Aktien.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	CHF	0,50%	/	2,80%	-4,87%	-0,75%
B - Thesaurierend	CHF	0,50%	/	2,80%	-4,88%	-0,75%
DB - Thesaurierend	CHF	0,64%	/	3,44%	-4,30%	-0,16%
EA - Ausschüttend	CHF	0,58%	/	3,15%	-4,55%	-0,42%
EB - Thesaurierend	CHF	0,58%	/	3,15%	-4,55%	-0,42%
IB - Thesaurierend	CHF	0,56%	/	3,09%	-4,62%	-0,48%
UA - Ausschüttend	CHF	0,54%	/	3,01%	-4,68%	-0,56%
UB - Thesaurierend	CHF	0,55%	/	3,02%	-4,69%	-0,56%

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	CHF	16.05.2023	0,23
EA - Ausschüttend	CHF	16.05.2023	5,45
UA - Ausschüttend	CHF	16.05.2023	0,42

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert		(in CHF)
CHF	514.868	USD	-590.000	23.05.2024	-13.341,91
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	9.244.703	EUR	-9.800.000	23.05.2024	-252.480,27
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften**-265.822,18****Swapkontrakte**

Art		Verbindlichkeiten		Forderungen	Fälligkeit	Bewertung		
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert			(in CHF)		
IRS	CHF	10.000.000	1.1327	CHF	10.000.000	1D/CHF-SSARON-OIS-COMPOUND	14.12.2026	-9.034,37

Jp Morgan Securities - London - Vereinigtes Königreich

Nichtrealisierter Nettominderwert aus Swapkontrakten**-9.034,37**

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

		31.03.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		168.203.130,65			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		14.079.426,93			
Forderungen aus Erträgen		1.062.951,61			
		183.345.509,19			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		523,47			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten		78.648,19			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		9.034,37			
		265.822,18			
		354.028,21			
Nettovermögen		182.991.480,98			
Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022	
Fondsvermögen	CHF	182.991.480,98	292.686.019,97	334.641.188,86	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	CHF	81,08	78,79	80,42	
B - Thesaurierend	CHF	111,65	108,17	110,07	
DB - Thesaurierend	CHF	1.020,33	982,66	993,74	
EA - Ausschüttend	CHF	892,08	866,79	884,85	
EB - Thesaurierend	CHF	1.022,97	987,77	1.001,65	
IB - Thesaurierend	CHF	1.046,80	1.011,46	1.026,34	
UA - Ausschüttend	CHF	88,88	86,36	88,15	
UB - Thesaurierend	CHF	97,11	93,90	95,35	
Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	CHF	140.719,995	233.129,060	1.599,338	94.008,403
B - Thesaurierend	CHF	405.924,339	474.648,565	55.056,779	123.781,005
DB - Thesaurierend	CHF	54.480,747	110.785,459	14.960,960	71.265,672
EA - Ausschüttend	CHF	4.201,671	2.173,671	2.630,000	602,000
EB - Thesaurierend	CHF	8.666,327	48.631,786	4.167,116	44.132,575
IB - Thesaurierend	CHF	50.914,940	56.535,162	45,000	5.665,222
UA - Ausschüttend	CHF	21.597,763	33.848,433	1.449,796	13.700,466
UB - Thesaurierend	CHF	29.259,222	43.485,284	2.508,331	16.734,393

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in CHF)Für die Periode vom
01.04.2023 bis zum
31.03.2024

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	292.686.019,97
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.235.455,79
Bankzinsen	124.211,79
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	15.587,05
	2.375.254,63
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	550.936,62
Depotbank- und Depotgebühr	125.893,36
Zentralverwaltungsvergütung	111.719,58
Druck- und Veröffentlichungskosten	9.128,49
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	66.740,89
"Taxe d'abonnement"	61.967,87
	926.386,81
Nettoerträge (-verluste)	1.448.867,82
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.227.639,45
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	178.304,32
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	171.454,94
	-2.877.880,19
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.429.012,37
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	9.250.060,41
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-9.034,37
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-177.883,61
	9.063.142,43
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	7.634.130,06
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	27.969.825,31
Rücknahmen	-145.233.149,41
	-117.263.324,10
Ausschüttung	-65.344,95
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	182.991.480,98

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	10,15
Frankreich	9,96
Grossbritannien	7,93
Deutschland	7,84
Niederlande	7,29
Kanada	6,81
Schweiz	5,95
Chile	5,92
Spanien	4,70
Südkorea	4,35
Österreich	3,40
Norwegen	3,24
Neuseeland	2,55
Schweden	2,16
Bermudas	1,63
Finnland	1,11
Jersey	1,09
Irland	1,08
Polen	1,08
Vereinigte Arabische Emirate	1,08
Supranational	1,07
Mexiko	0,79
Luxemburg	0,53
Dänemark	0,19
Island	0,00
Total	91,92

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	62,07
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	11,00
Telekommunikation	4,68
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	2,72
Immobilien	1,98
Verkehr und Transport	1,61
Verpackungsindustrie	1,13
Luft- und Raumfahrtindustrie	1,09
Energie- und Wasserversorgung	1,09
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,09
Supranationale Organisationen	1,07
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,05
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,81
Elektronik und Halbleiter	0,33
Diverse Dienstleistungen	0,19
Total	91,92

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
EUR SHARE CERTIFICATE GLITNIR HOLDCO EHF	77.548	0,08	0,00
Total Aktien		0,08	0,00
Anleihen			
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	3.000.000	3.075.000,00	1,68
CHF AFRICA FINANCE CORP 1.205%/20-30.09.2025	2.000.000	1.966.000,00	1,07
CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025	2.000.000	1.962.000,00	1,07
CHF ALPIO HOLDING AG 1.75%/22-240626	3.000.000	2.995.500,00	1,64
CHF AMAG LEASING AG 0.525%/21-271026	1.000.000	965.500,00	0,53
CHF AMAG LEASING AG 0.875%/17-251024	2.000.000	1.987.400,00	1,09
CHF ANZ NEW ZEALAND INTL/LDN 0.35%/18-22.10.2024	2.700.000	2.682.180,00	1,47
CHF AROUNDTOWN SA 0.732%/18-300125	1.000.000	971.500,00	0,53
CHF ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025	2.000.000	1.983.400,00	1,08
CHF AT&T 1.875%/14-04.12.2024	2.000.000	1.998.800,00	1,09
CHF BANC CREDITO INVERSIONES 0.4%/19-221124	3.000.000	2.974.800,00	1,63
CHF BANCO BILBAO SA 2.4075%/22-281125	2.000.000	2.027.000,00	1,11
CHF BANCO MERCANTILE DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024	1.470.000	1.447.215,00	0,79
CHF BANCO SANTANDER CHILE 0.384%/19-270924	1.000.000	993.000,00	0,54
CHF BANCO SANTANDER SA 2.395%/24-160229	2.000.000	2.040.000,00	1,11
CHF BANK OF AMERICA CORP 0.2525%/19-12.06.2026	2.000.000	1.948.000,00	1,06
CHF BANQUE FED CR MUTUEL 546 2.3%/23-300127	1.000.000	1.019.000,00	0,56
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.25%/19-10.07.2025	3.000.000	2.953.200,00	1,61
CHF BARCLAYS PLC 0.315%/21-040627	3.000.000	2.869.500,00	1,57
CHF BAWAG AG 2.0525%/23-140428	2.000.000	2.036.000,00	1,11
CHF BNP PARIBAS (SUBORDINATED) 1.75%/15-05.06.2025	3.000.000	3.000.000,00	1,64
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	3.500.000	3.368.750,00	1,84
CHF CBQ FINANCE LTD 0.735%/20-27.11.2024	3.000.000	2.976.000,00	1,63
CHF CELLNEX FINANCE CO SA 0.935%/21-260326	2.000.000	1.965.000,00	1,07
CHF CELLNEX TELECOM SA 0.775%/20-180227	500.000	482.750,00	0,26
CHF CEMBRA MONEY BANK AG 0.1525%/19-141026	2.000.000	1.930.000,00	1,05
CHF CITIGROUP INC 0.5%/17-22.11.2024	2.000.000	1.986.800,00	1,09
CHF COMMERZBANK AG 1.1%/18-110725	1.000.000	991.000,00	0,54
CHF COMMERZBANK AG 3.8%/23-030528	1.000.000	1.049.000,00	0,57
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	2.000.000	2.081.000,00	1,14
CHF CREDIT AGRICOLE (SUBORDINATED.) 2.125%/01-29.09.2025	1.000.000	1.004.500,00	0,55
CHF CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.5%/20-01.10.2026	2.000.000	1.939.000,00	1,06
CHF DAIMLER INTL FINANCE BV 0.85%/18-14.11.2025	1.000.000	990.500,00	0,54
CHF DEUTSCHE BANK AG 0.8%/20-070225	1.000.000	992.600,00	0,54
EUR DEUTSCHE BANK AG FF FRN/20-100626	2.000.000	1.888.633,04	1,03
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2.875%/17-28.06.2027	1.000.000	503.271,67	0,28
CHF DIGITAL INTREPID 1.7%/22-300327	2.000.000	1.977.000,00	1,08
CHF DNB BANK ASA 1.1675%/22-030627	2.000.000	1.972.000,00	1,08
CHF EDF 0.3%/16-14.10.2024	2.000.000	1.988.000,00	1,09
CHF EQUINIX INC 2.875%/23-120928	2.570.000	2.647.100,00	1,45
CHF ERSTE GROUP BANK AG 0.25%/21-021028	500.000	467.000,00	0,26
EUR ERSTE GROUP BANK AG 0.875%/20-130527	2.000.000	1.802.797,58	0,99
CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.17%/17-18.07.2025	2.000.000	1.966.400,00	1,07
CHF FCA CAPITAL SUISSE SA 0.0519%/21-201224	1.000.000	987.900,00	0,54
CHF FED CAISSES DESJARDINS 1.735%/23-310128	2.000.000	2.023.000,00	1,11
CHF FIRST ABU DHABI BK P.J.S.C 0.401%/021024	2.000.000	1.985.400,00	1,08
EUR GLITNIR 0%/16-08.01.2030	12.488	30,37	0,00
CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025	2.000.000	1.982.000,00	1,08
CHF HEATHROW FUNDING 0.5%/16-170526	2.000.000	1.997.000,00	1,09
CHF HSBC HOLDINGS PLC 0.32%/21-031127	1.400.000	1.335.600,00	0,73
CHF HSBC HOLDINGS PLC 1.805%/22-010626	1.000.000	997.500,00	0,55
EUR ING GROUP (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 17-26.09.2029	2.000.000	1.919.761,04	1,05
CHF INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0.25%/19-30.09.2024	2.000.000	1.985.200,00	1,08
EUR ISS GLOBAL 2.125%/14-02.12.2024	371.000	356.245,59	0,19
CHF LLOYDS BANKING GROUP PLC 1%/18-04.03.2025	3.000.000	2.986.200,00	1,63
CHF MBANK S.A. 1.0183%/19-041024	2.000.000	1.977.600,00	1,08
CHF MCDONALD'S 0.17%/16-04.10.2024	1.500.000	1.490.250,00	0,81
EUR MERCK REG S FF 14-121274	2.000.000	1.926.628,65	1,05
CHF METROPOLITAN LIFE GLOBAL 0.3%/17-190126	2.000.000	1.956.000,00	1,07
CHF MONDELEZ INTERNATIONAL 1.125%/15-30.12.2025	2.000.000	1.988.000,00	1,09
CHF MUENCHENER EG 0.4%/22-250226	1.000.000	974.000,00	0,53
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.1%/20-17.12.2025	2.000.000	1.948.000,00	1,06
CHF NATI BUILDING SOCI 1.7575%/23-230126	2.000.000	2.007.000,00	1,10
CHF NATWEST MARKETS PLC 0.8975%/22-040425	1.400.000	1.391.740,00	0,76
EUR NATWEST MARKETS PLC 1%/19-28.05.2024	1.000.000	968.372,63	0,53
CHF NORDEA BANK ABP 1.81%/22-150627	1.000.000	1.005.500,00	0,55
CHF NORDEA BANK ABP 2.49%/23-260528	1.000.000	1.031.500,00	0,56
CHF ORANGE SA 0.2%/19-24.11.2025	2.200.000	2.156.000,00	1,18
CHF RAIFFEISENLANDESBANK OBERO 0.175%/291026	2.000.000	1.916.000,00	1,05

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
CHF RCI BANQUE SA 3.5%/23-100528	2.000.000	2.114.000,00	1,16
CHF ROYAL BANK CANADA 0.4%/22-051027	1.000.000	976.000,00	0,53
CHF ROYAL BANK OF CANADA 1.45%/22-040527	2.000.000	1.992.000,00	1,09
CHF SANTANDER FINANCE 2.9325%/23-040728	2.000.000	2.091.000,00	1,14
CHF SCOTIABANK CHILE 0.385%/21-220726	2.930.000	2.825.985,00	1,54
CHF SOCIETE GENERALE SA 2.625%/22-141026	2.000.000	2.050.000,00	1,12
CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025	2.000.000	1.956.000,00	1,07
CHF SPAREBANK 1 SMN 1.5%/22-150627	2.000.000	1.998.000,00	1,09
CHF SVENSKA HANDELSBANKEN 1.25%/22-240527	2.000.000	1.989.000,00	1,09
CHF TANNER SERVICIOS SA 1.15%/21-260424	2.000.000	1.977.600,00	1,08
CHF THE KOREA DEVELOPMENT BANK 0.445%/20-08.05.2025	3.000.000	2.964.600,00	1,62
CHF THERMO FISHER SCIENTIF 1.6525%/24-070328	600.000	603.900,00	0,33
CHF TORONTO-DOMINION BANK 2.2025%/23-310128	2.000.000	2.044.000,00	1,12
CHF TOYOTA MOTOR FIN 2.13%/23-150627	1.560.000	1.588.860,00	0,87
CHF UBS AG LONDON BRANCH 2.33%/22-141125	2.000.000	2.027.000,00	1,11
CHF VERIZON COMMUNICATIONS 1%/17-301127	2.000.000	1.967.000,00	1,07
CHF VODAFONE GROUP 0.625%/17-150327	2.000.000	1.956.000,00	1,07
CHF VOLKSWAGEN FIN NV 2.2075%/24-120227	1.690.000	1.713.660,00	0,94
Total Anleihen		156.991.130,57	85,79
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		156.991.130,65	85,79
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 2.3825%/23-220927	2.000.000	2.054.000,00	1,12
CHF DZ BANK AG -2.2025%/23-180928	2.000.000	2.041.000,00	1,12
CHF EMBOTELLADORA AN 2.7175%/23-200928	2.000.000	2.068.000,00	1,13
CHF KOREA HOUSING FINANCE CORP 1.778%/24-010	3.000.000	3.024.000,00	1,65
CHF LANDESBANK WUERTEMBERG 2.39%/24-080229	2.000.000	2.025.000,00	1,11
Total Anleihen		11.212.000,00	6,13
Nicht börsennotierte Wertpapiere		11.212.000,00	6,13
Total des Wertpapierbestandes		168.203.130,65	91,92
Bareinlagen bei Banken und Brokern		14.079.426,93	7,69
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-523,47	0,00
Andere Nettovermögenswerte		709.446,87	0,39
Fondsvermögen		182.991.480,98	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	1498949	LU0155953028	0,60%	0,81%
B - Thesaurierend	USD	1498955	LU0155953705	0,60%	0,81%
DA - Ausschüttend	USD	52329864	LU2039696278	0,00%	0,12%
DB - Thesaurierend	USD	1571294	LU0164804360	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	USD	23529720	LU1024301316	0,25%	0,45%
EB - Thesaurierend	USD	11660401	LU0535913965	0,25%	0,43%
IB - Thesaurierend	USD	1498957	LU0155953960	0,30%	0,52%
UA - Ausschüttend	USD	26364768	LU1144399836	0,45%	0,66%
UB - Thesaurierend	USD	26367338	LU1144399919	0,45%	0,66%

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die -DA- und -DB- Aktien.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	USD	0,75%	/	5,14%	-4,27%	-0,44%
B - Thesaurierend	USD	0,75%	/	5,14%	-4,27%	-0,43%
DA - Ausschüttend	USD	0,89%	/	5,91%	-3,59%	0,27%
DB - Thesaurierend	USD	0,89%	/	5,91%	-3,59%	0,27%
EA - Ausschüttend	USD	0,85%	/	5,54%	-3,90%	-0,05%
EB - Thesaurierend	USD	0,85%	/	5,54%	-3,90%	-0,05%
IB - Thesaurierend	USD	0,83%	/	5,45%	-3,98%	-0,14%
UA - Ausschüttend	USD	0,79%	/	5,30%	-4,13%	-0,29%
UB - Thesaurierend	USD	0,78%	/	5,30%	-4,12%	-0,29%

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	16.05.2023	1,62
DA - Ausschüttend	USD	16.05.2023	25,78
EA - Ausschüttend	USD	16.05.2023	22,44
UA - Ausschüttend	USD	16.05.2023	1,97

Erläuterungen**Finanzterminkontrakte**

Beschreibung	Währung	Anzahl	Verpflichtungen (in Währung des Terminkontrakts)	Bewertung In USD
Gegenpartei US TREASURY NOTES 5 YEARS -100000- 28/06/2024	USD	30	3.210.468,75	6.093,75

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten**6.093,75**

Gegenpartei: Credit Suisse (Schweiz) AG

Devisentermingeschäfte

Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Bewertung (In USD)
Gegenpartei USD 7.266.820	EUR -6.700.000	23.05.2024	13.876,77
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland			

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften**13.876,77**

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.03.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		188.043.465,05			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.702.160,19			
Forderungen aus Erträgen		1.487.157,32			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten		6.093,75			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		13.876,77			
		191.252.753,08			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		73.204,19			
		73.204,19			
Nettovermögen		191.179.548,89			
Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022	
Fondsvermögen	USD	191.179.548,89	383.333.227,53	456.333.660,44	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	83,78	81,65	83,25	
B - Thesaurierend	USD	155,81	148,85	148,90	
DA - Ausschüttend	USD	980,57	956,07	975,02	
DB - Thesaurierend	USD	1.219,83	1.157,48	1.149,47	
EA - Ausschüttend	USD	972,79	948,10	966,93	
EB - Thesaurierend	USD	1.218,79	1.159,90	1.155,77	
IB - Thesaurierend	USD	1.154,21	1.099,40	1.096,44	
UA - Ausschüttend	USD	94,82	92,41	94,24	
UB - Thesaurierend	USD	115,95	110,61	110,48	
Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	USD	87.664,958	157.793,820	108,091	70.236,953
B - Thesaurierend	USD	243.426,250	311.520,005	36.629,016	104.722,771
DA - Ausschüttend	USD	5.033,297	9.311,616	0,000	4.278,319
DB - Thesaurierend	USD	67.707,130	161.120,549	6.614,733	100.028,152
EA - Ausschüttend	USD	3.023,216	19.129,552	564,714	16.671,050
EB - Thesaurierend	USD	27.324,345	52.884,087	10.741,205	36.300,947
IB - Thesaurierend	USD	7.314,893	26.096,311	7.229,825	26.011,243
UA - Ausschüttend	USD	32.476,261	50.583,768	1.219,933	19.327,440
UB - Thesaurierend	USD	91.547,969	143.209,905	36.501,519	88.163,455

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.04.2023 bis zum
31.03.2024

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	383.333.227,53
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	9.356.860,71
Bankzinsen	62.384,87
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	55.796,78
	9.475.042,36
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	693.774,01
Depotbank- und Depotgebühr	175.414,43
Zentralverwaltungsvergütung	105.024,74
Druck- und Veröffentlichungskosten	10.141,46
Zinsen und Bankspesen	2.344,15
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	52.185,36
"Taxe d'abonnement"	45.772,80
	1.084.656,95
Nettoerträge (-verluste)	8.390.385,41
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-10.490.029,10
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-13.291,47
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	504.325,80
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	132.109,52
	-9.866.885,25
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.476.499,84
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	16.299.949,33
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	6.093,75
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-255.082,39
	16.050.960,69
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	14.574.460,85
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	38.682.786,56
Rücknahmen	-244.413.253,92
	-205.730.467,36
Ausschüttung	-997.672,13
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	191.179.548,89

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	50,56
Niederlande	9,78
Frankreich	6,79
Grossbritannien	6,63
Deutschland	3,67
Kanada	3,35
Japan	2,42
Schweiz	2,06
Supranational	1,76
Vereinigte Arabische Emirate	1,56
Irland	1,46
Belgien	1,44
Schweden	1,19
Spanien	1,15
Kaimaninseln	1,14
Ägypten	1,04
Singapur	1,04
Italien	0,82
Österreich	0,52
Total	98,36

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	39,38
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	26,99
Computerhardware und Netzwerk	7,13
Gesundheits- und Sozialdienste	3,65
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,97
Supranationale Organisationen	2,80
Einzelhandel und Warenhäuser	2,39
Telekommunikation	1,98
Länder und Zentralregierungen	1,63
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,61
Maschinenbau und Industrieanlagen	1,51
Elektrische Geräte und Komponenten	1,03
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,00
Immobilien	0,99
Biotechnologie	0,97
Petroleum	0,82
Verschiedene Konsumgüter	0,79
Energie- und Wasserversorgung	0,72
Total	98,36

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD 7-ELEVEN INC 0.95%/21-10.02.2026	3.000.000	2.772.870,00	1,45
USD ABN AMRO BANK NV 6.339%/23-180927	700.000	712.145,00	0,37
USD ABN AMRO BANK REG S 4.75%/15-280725	3.000.000	2.958.780,00	1,55
USD AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.75%/21-291024	2.850.000	2.784.421,50	1,46
USD AFRICA FINANCE CORP 3.125%/20-16.06.2025	3.500.000	3.371.480,00	1,76
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BA 4.125%/17-20.06.2024	2.000.000	1.990.140,00	1,04
USD ALLY FINANCIAL INC 3.875%/19-210524	1.000.000	997.140,00	0,52
USD AMAZON.COM INC 1.65%/21-120526	2.000.000	1.787.460,00	0,93
USD AMERICAN TOWER CORP 1.3%/20-15.09.2025	2.000.000	1.886.280,00	0,99
USD AMGEN INC 2.2%/20-21.02.2027	2.000.000	1.852.060,00	0,97
USD ANGLO AMERICAN CAP REG S 4.75%/17-100427	2.000.000	1.961.680,00	1,03
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL 3.625%/17-110924	1.500.000	1.483.545,00	0,78
USD ANTHEM INC 2.375%/19-15.01.2025	1.000.000	975.800,00	0,51
USD APPLE INC 1.4%/21-050828	3.250.000	2.858.895,00	1,50
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 1.2%/21-280526	3.000.000	2.771.820,00	1,45
USD BANCO SANTANDER SA S114 FF FRN/21-140927	2.400.000	2.190.840,00	1,15
USD BANK OF AMERICA CORP FF FRN/23-150927	2.500.000	2.534.525,00	1,33
USD BANK OF AMERICA CORP FF FRN/23-200127	1.500.000	1.493.355,00	0,78
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025	1.500.000	1.473.465,00	0,77
USD BARCLAYS 3.65%/15-16.03.2025	2.000.000	1.961.920,00	1,03
USD BNP PARIBAS FF FRN/20-090626	1.500.000	1.442.670,00	0,75
USD BNP PARIBAS FF FRN/21-130127	2.000.000	1.859.620,00	0,97
USD BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	414.000	406.817,10	0,21
USD BPCE S.A. 6.6120%/23-191027	3.000.000	3.063.540,00	1,60
USD BROADCOM INC 3.15%/20-15.11.2025	3.000.000	2.903.640,00	1,52
USD CHARTER COM OP 4.908%/16-230725	2.000.000	1.976.900,00	1,03
USD CITIGROUP INC FF FRN/21-090627	2.000.000	1.836.880,00	0,96
USD CITIGROUP INC FF FRN/22-290926	1.500.000	1.502.715,00	0,79
USD CNH INDUSTRIAL NV 3.85%/17-15.11.2027	3.000.000	2.882.070,00	1,51
USD CREDIT AGRICOLE LONDON FF FRN/20-160626	4.000.000	3.825.760,00	2,00
USD CVS HEALTH 3.875%/15-200725	1.000.000	981.700,00	0,51
USD CVS HEALTH CORP 2.625%/19-150624	1.000.000	989.470,00	0,52
USD CVS HEALTH CORP 5%/23-200226	500.000	498.430,00	0,26
USD CVS HEALTH CORP 5%/23-300129	600.000	601.458,00	0,31
USD DELL INT LLC / EMC CORP 5.25%/23-010228	1.350.000	1.366.966,00	0,72
EUR DEUTSCHE BAHN FIN GMBH SUB FF FRN/19-PER	1.500.000	1.562.506,20	0,82
USD DEUTSCHE BANK 3.7%/14-30.05.2024	2.000.000	1.993.120,00	1,04
USD DEUTSCHE BANK NY S D FF FRN/19-261125	3.500.000	3.453.205,00	1,81
USD EDP FINANCE BV 3.625%/17-150724	2.500.000	2.484.300,00	1,30
USD ENBRIDGE INC 1.6%/21-041026	1.500.000	1.375.515,00	0,72
USD ENEL FINANCE INTL NV 6.8%/22-141025	2.000.000	2.041.640,00	1,07
USD ENEL FINANCE N.V. 4.25%/22-150625	1.450.000	1.427.858,50	0,75
EUR ENI SPA SUB FF FRN/20-PERPET	1.500.000	1.572.760,80	0,82
USD EUROCLEAR BANK SA 1.261%/21-030626	3.000.000	2.750.040,00	1,44
EUR FIRST ABU DHABI BANK PJS 0.125%/21-16.02.2026	2.950.000	2.977.253,28	1,56
USD FORD MOTOR CREDIT 6.798%/23-071128	800.000	835.096,00	0,44
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.95%/23-100626	1.600.000	1.636.408,00	0,86
USD GE HEALTHCARE TECH INC 5.55%/23-151124	2.000.000	1.997.580,00	1,04
USD GENERAL MOTORS FINL 5.4%/24-080527	1.150.000	1.153.772,00	0,60
USD GENERAL MOTORS FINL CO 1.25%/21-080126	750.000	698.587,50	0,37
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC FF FRN/21-120226	4.000.000	3.832.480,00	2,00
USD HCA 5.375%/15-010225	2.500.000	2.493.650,00	1,30
USD HCA 5.875%/15-150226	1.500.000	1.506.990,00	0,79
USD HP ENTERPRISE CO 1.75%/20-01.04.2026	4.000.000	3.736.280,00	1,95
USD HP INC 2.2%/20-17.06.2025	2.750.000	2.647.232,50	1,38
USD HSBC HOLDINGS PLC FIX-TO-FRN FRN/20-18.04.2026	2.500.000	2.395.750,00	1,25
USD HSBC HOLDINGS PLC FRN/21-240525	2.000.000	1.984.800,00	1,04
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA 1.8%/20-15.10.2025	2.000.000	1.891.040,00	0,99
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.95%/23-210926	1.450.000	1.467.226,00	0,77
USD IBM CORP 4%/22-270725	1.500.000	1.477.140,00	0,77
USD ING GROUP NV FRN/22-280326	3.500.000	3.437.630,00	1,80
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/20-130326	2.500.000	2.417.025,00	1,26
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-040227	3.500.000	3.238.900,00	1,69
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC FIX-TO-FRN FRN/20-09.07.2025	2.500.000	2.486.700,00	1,30
USD MATTEL INC 5.875%/19-15.12.2027	1.500.000	1.506.345,00	0,79
USD MET LIFE GLOB FUNDING I 3%/17-190927	1.200.000	1.124.916,00	0,59
USD MITSUBISHI UFJ FRN/22-120925	1.800.000	1.793.970,00	0,94
USD MONDELEZ INTERNATIONAL 1.5%/20-040525	2.000.000	1.918.940,00	1,00
USD MORGAN STANLEY S 1 FF FRN/20-101226	3.000.000	2.781.120,00	1,45
USD MORGAN STANLEY S I FF FRN/22-170726	1.000.000	989.390,00	0,52
USD NISSAN MOTOR 2%/21-090326	3.000.000	2.779.440,00	1,45
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.648%/20-160125	1.000.000	976.650,00	0,51
USD NXP BV/NXP FDG/NXP USA 2.7%/22-010525	1.500.000	1.456.350,00	0,76
USD ORACLE CORP 1.65%/21-250326	1.500.000	1.400.865,00	0,73
USD ORACLE CORP 2.8%/20-01.04.2027	1.500.000	1.407.810,00	0,74
USD PFIZER INVESTMENT ENTER 4.45%/23-190526	2.000.000	1.980.320,00	1,04
USD PRINCIPAL LFE GLB FND II 1.25%/20-23.06.2025	1.000.000	952.030,00	0,50
USD PROSUS N.V. 3.257%/22-190127	1.000.000	928.050,00	0,49
USD QNB FINANCE LTD 1.625%/20-22.09.2025	2.300.000	2.175.179,00	1,14
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE FIX-TO-FRN (REG. -S-) (SUBORDINATED) 15-25.03.2075	1.000.000	1.079.881,20	0,56
USD ROYAL BANK OF CANADA 4.875%/23-120126	2.000.000	1.994.000,00	1,04

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen. Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettövermö- gens
USD SOCIETE GENERALE SA 1.488%/20-14.12.2026	3.000.000	2.787.810,00	1,46
USD SUMITOMO MITSUI FINL GRP 0.948%/21- 12.01.2026	2.000.000	1.857.420,00	0,97
USD SUZANO AUSTRIA (REG. -S-) 5.75%/16- 14.07.2026	1.000.000	1.000.750,00	0,52
USD SWEDBANK AB 6.136%/23-120926	2.250.000	2.283.300,00	1,19
USD T-MOBILE USA INC 2.25%/21-150226	4.000.000	3.785.960,00	1,98
USD TORONTO-DOMINION BK 5.532%/23-170726	3.000.000	3.027.930,00	1,58
USD TOYOTA MOTOR CREDIT 5.4%/23-201126	1.750.000	1.771.070,00	0,93
USD UBS GROUP AG FF FRN/22-120526	4.000.000	3.943.440,00	2,06
USD US TREASURY N/B 4%/23-300628	1.750.000	1.730.927,73	0,91
USD US TREASURY N/B 3 U-26 0.375%/21-310126	1.500.000	1.387.177,74	0,73
USD VMWARE INC 3.9%/17-210827	1.000.000	958.870,00	0,50
USD VMWARE INC 4.5%/20-15.05.2025	1.000.000	990.570,00	0,52
USD WARNERMEDIA HOLDING INC 3.755%/23- 150327	2.000.000	1.908.720,00	1,00
USD WELLS FARGO & COM FRN/22-250426	3.500.000	3.435.590,00	1,80
Total Anleihen		188.043.465,05	98,36
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		188.043.465,05	98,36
Total des Wertpapierbestandes		188.043.465,05	98,36
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.702.160,19	0,89
Andere Nettowertmögenswerte		1.433.923,65	0,75
Fondsvermögen		191.179.548,89	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettowertmögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr
A - Ausschüttend	CHF	1664162	LU0175163707	0,75%
B - Thesaurierend	CHF	1664165	LU0175163889	0,75%
EB - Thesaurierend	CHF	22716069	LU0987306726	0,30%
IB - Thesaurierend	CHF	1664170	LU0175164002	0,38%
UA - Ausschüttend	CHF	26377043	LU1144400600	0,45%
UB - Thesaurierend	CHF	26377052	LU1144400782	0,45%

Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund wurde am 11.03.2024 geschlossen.

Fondsperformance

		PTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	CHF	0,71%	/	1,90%	-0,19%	3,93%
B - Thesaurierend	CHF	0,71%	/	1,91%	-0,20%	3,94%
EB - Thesaurierend	CHF	0,80%	/	2,41%	0,29%	4,44%
IB - Thesaurierend	CHF	0,78%	/	2,29%	0,17%	4,32%
UA - Ausschüttend	CHF	0,76%	/	2,21%	0,10%	4,25%
UB - Thesaurierend	CHF	0,77%	/	2,21%	0,10%	4,25%

PTD = Performance To Date (01.01.2024 - 11.03.2024)

		Ex-Datum	Betrag
UA - Ausschüttend	CHF	16.05.2023	0,06

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

Fondsentwicklung		*11.03.2024	31.03.2023	31.03.2022	
Fondsvermögen	CHF	47.533.094,72	66.748.944,76	100.766.437,73	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	CHF	95,11	92,49	94,49	
B - Thesaurierend	CHF	115,20	112,03	114,45	
EB - Thesaurierend	CHF	1.066,84	1.032,78	1.049,91	
IB - Thesaurierend	CHF	1.055,14	1.022,48	1.040,62	
UA - Ausschüttend	CHF	101,06	98,07	99,88	
UB - Thesaurierend	CHF	104,77	101,59	103,48	
*letzter TNA vor Liquidation					
Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	CHF	0,000	145.317,210	1.601,060	146.918,27
B - Thesaurierend	CHF	0,000	267.413,803	8.133,409	275.547,21
EB - Thesaurierend	CHF	0,000	2.741,107	0,000	2.741,11
IB - Thesaurierend	CHF	0,000	3.133,664	0,000	3.133,66
UA - Ausschüttend	CHF	0,000	55.995,326	500,000	56.495,33
UB - Thesaurierend	CHF	0,000	116.374,679	3.106,428	119.481,11

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in CHF)

	Für die Periode vom 01.04.2023 bis zum 11.03.2024 (Liquidationsdatum)
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	66.748.944,76
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	389.511,56
Bankzinsen	21.874,01
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.618,55
	414.004,12
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	339.594,82
Depotbank- und Depotgebühr	30.072,53
Zentralverwaltungsvergütung	36.659,97
Druck- und Veröffentlichungskosten	7.306,58
Zinsen und Bankspesen	163,07
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	81.033,08
"Taxe d'abonnement"	19.884,67
	514.714,72
Nettoerträge (-verluste)	-100.710,60
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-1.325.829,80
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	-33.049,22
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-8,80
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	6.301,99
	-1.352.585,83
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.453.296,43
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	3.502.715,50
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-450.131,23
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	8,33
	3.052.592,60
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	1.599.296,17
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	1.450.836,59
Rücknahmen	-69.795.930,44
	-68.345.093,85
Ausschüttung	-3.147,08
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	0,00

Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	CHF	348875	LU0049528473	0,80%	1,02%
B - Thesaurierend	CHF	348879	LU0049527079	0,80%	1,02%
EB - Thesaurierend	CHF	11659947	LU0535912561	0,20%	0,38%
UA - Ausschüttend	CHF	26377146	LU1144401087	0,50%	0,72%
UB - Thesaurierend	CHF	26377227	LU1144401160	0,50%	0,72%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	CHF	0,40%	/	4,12%	-9,01%	-1,83%
B - Thesaurierend	CHF	0,41%	/	4,12%	-9,02%	-1,82%
EB - Thesaurierend	CHF	0,57%	/	4,78%	-8,43%	-1,20%
UA - Ausschüttend	CHF	0,49%	/	4,43%	-8,74%	-1,52%
UB - Thesaurierend	CHF	0,48%	/	4,43%	-8,74%	-1,53%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
UA - Ausschüttend	CHF	16.05.2023	0,11

Erläuterungen**Swapkontrakte**

Art	Verbindlichkeiten		Forderungen		Fälligkeit	Bewertung (in CHF)		
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert					
IRS	CHF	10.000.000	1.1867	CHF	10.000.000	1D/CHF-SSARON-OIS-COMPOUND	13.12.2030	-58.609,97

Jp Morgan Securities - London - Vereinigtes Königreich

Nichtrealisierter Nettominderwert aus Swapkontrakten**-58.609,97**

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

		31.03.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		250.330.843,14			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.168.602,53			
Forderungen aus Erträgen		1.313.899,23			
		254.813.344,90			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		727,54			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten		170.489,79			
		58.609,97			
		229.827,30			
Nettovermögen		254.583.517,60			
Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022	
Fondsvermögen	CHF	254.583.517,60	286.381.866,68	318.063.229,31	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	CHF	258,90	248,09	259,94	
B - Thesaurierend	CHF	498,64	477,80	500,64	
EB - Thesaurierend	CHF	120,12	114,37	119,07	
UA - Ausschüttend	CHF	90,77	86,82	90,74	
UB - Thesaurierend	CHF	94,22	90,01	94,04	
Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	CHF	110.917,121	123.176,337	908,170	13.167,386
B - Thesaurierend	CHF	201.943,973	215.091,271	1.888,650	15.035,948
EB - Thesaurierend	CHF	1.012.785,554	1.307.153,778	74.586,845	368.955,069
UA - Ausschüttend	CHF	22.628,044	24.456,547	0,000	1.828,503
UB - Thesaurierend	CHF	15.553,990	15.943,116	50,000	439,126

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in CHF)Für die Periode vom
01.04.2023 bis zum
31.03.2024

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	286.381.866,68
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.717.204,88
Bankzinsen	44.317,17
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14.505,12
	2.776.027,17
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.352.797,80
Depotbank- und Depotgebühr	160.908,95
Zentralverwaltungsvergütung	195.852,07
Druck- und Veröffentlichungskosten	7.844,49
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	115.518,86
"Taxe d'abonnement"	80.633,45
	1.913.555,62
Nettoerträge (-verluste)	862.471,55
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.923.410,46
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-533,58
	-3.923.944,04
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-3.061.472,49
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	16.003.006,83
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-58.609,97
	15.944.396,86
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	12.882.924,37
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	9.826.733,52
Rücknahmen	-54.505.316,75
	-44.678.583,23
Ausschüttung	-2.690,22
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	254.583.517,60

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Frankreich	13,83
Vereinigte Staaten	12,83
Kanada	12,06
Deutschland	11,89
Australien	6,60
Grossbritannien	5,64
Niederlande	5,62
Österreich	5,22
Finnland	3,32
Schweiz	2,77
Schweden	2,71
Dänemark	1,89
Supranational	1,77
Neuseeland	1,75
Norwegen	1,69
Philippinen	1,68
Spanien	1,46
Vereinigte Arabische Emirate	1,30
Mexiko	1,16
Südkorea	0,68
Luxemburg	0,67
Venezuela	0,58
Irland	0,55
Chile	0,41
Guernsey	0,25
Island	0,00
Total	98,33

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	60,59
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	12,23
Supranationale Organisationen	5,29
Kantone, Bundesländer, Provinzen	4,66
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	3,97
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	2,46
Telekommunikation	2,43
Computerhardware und Netzwerk	0,99
Verkehr und Transport	0,92
Energie- und Wasserversorgung	0,91
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,71
Elektrische Geräte und Komponenten	0,66
Versicherungsgesellschaften	0,60
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,59
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	0,52
Verpackungsindustrie	0,41
Elektronik und Halbleiter	0,40
Total	98,33

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
EUR SHARE CERTIFICATE GLITNIR HOLDCO EHF	797.623	0,78	0,00
Total Aktien		0,78	0,00
Anleihen			
CHF ABN AMRO BANK 3.375%/06-150831	700.000	797.650,00	0,31
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	2.000.000	2.050.000,00	0,81
CHF ADB 1.5525%/23-030833	1.500.000	1.554.000,00	0,61
CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025	1.000.000	981.000,00	0,39
CHF AKADEMISKA HUS 0.3%/17-08.10.2029	2.250.000	2.125.125,00	0,83
CHF AKADEMISKA HUS 1.68%/22-200932	750.000	765.750,00	0,30
CHF APPLE 0.75%/15-25.02.2030	2.600.000	2.528.500,00	0,99
CHF ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025	2.000.000	1.983.400,00	0,78
CHF ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75%/10-12.02.2030	2.500.000	2.731.250,00	1,07
CHF AT&T 1.875%/14-04.12.2024	1.000.000	999.400,00	0,39
CHF BANCO MERCANTILE DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024	3.000.000	2.953.500,00	1,16
CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	1.250.000	1.189.375,00	0,47
CHF BANCO SANTANDER SA 2.24%/24-160232	1.500.000	1.539.750,00	0,60
CHF BANK OF MONTREAL 2.26%/23-010229	600.000	618.900,00	0,24
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.1425%/21-251028	1.500.000	1.405.500,00	0,55
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.2%/18-19.11.2025	1.500.000	1.470.000,00	0,58
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.3025%/21-300731	3.000.000	2.713.500,00	1,07
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.2%/19-12.06.2026	2.250.000	2.184.750,00	0,86
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027	2.250.000	2.182.500,00	0,86
CHF BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.25%/19-24.10.2029	1.500.000	1.383.750,00	0,54
CHF BAWAG P.S.K. 1.96%/23-260531	1.500.000	1.530.750,00	0,60
CHF BAWAG P.S.K. 2.955%/22-291127	1.500.000	1.551.750,00	0,61
CHF BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028	1.000.000	937.000,00	0,37
CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	1.500.000	1.469.250,00	0,58
CHF BNG 2.5%/05-21.07.2025	5.000.000	5.079.000,00	2,00
CHF BNP PARIBAS (SUBORDINATED) 1.75%/15-05.06.2025	1.000.000	1.000.000,00	0,39
CHF BNP PARIBAS 2.63%/23-070629	1.400.000	1.466.500,00	0,58
CHF BNP PARIBAS SA 0.3%/19-15.10.2027	1.400.000	1.334.200,00	0,52
CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LB) 11%/20-24.07.2028	845.000	792.610,00	0,31
CHF CAISSE DES DEPOTS ET CON 0.3%/17-12.11.2027	2.400.000	2.320.800,00	0,91
CHF CANADIAN IMP BK OF COM 0.18%/21-200429	3.000.000	2.794.500,00	1,10
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	1.000.000	962.500,00	0,38
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025	1.500.000	1.467.000,00	0,58
CHF CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.405%/20-25.06.2025	1.750.000	1.723.575,00	0,68
CHF CFF 2.5%/06-24.02.2031	1.000.000	1.071.000,00	0,42
CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028	1.005.000	953.745,00	0,37
CHF CITIGROUP INC 0.75%/19-02.04.2026	3.590.000	3.537.945,00	1,39
CHF COCA-COLA (REG. -S-) 1%/15-02.10.2028	1.800.000	1.785.500,00	0,70
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.1575%/21-081231	550.000	499.125,00	0,20
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	3.400.000	3.315.000,00	1,30
CHF COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA 1.24%/020929	340.000	337.280,00	0,13
CHF COOPERATIVE RABOBK UA 2.4875%/23-250129	1.400.000	1.437.100,00	0,56
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	2.000.000	2.081.000,00	0,82
CHF CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.5%/15-26.02.2026	500.000	489.750,00	0,19
CHF CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/14-01.12.2028	1.000.000	982.500,00	0,39
CHF CREDIT AGRICOLE (SUBORDINATED.) 2.125%/01-29.09.2025	500.000	502.250,00	0,20
CHF CREDIT AGRICOLE CIB FINANCIAL SOLUTIONS 0.1275%/20-27.07.2028	1.000.000	936.500,00	0,37
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.25%/17-27.07.2027	1.250.000	1.204.375,00	0,47
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.45%/19-24.01.2029	2.000.000	1.909.000,00	0,75
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.1%/16-26.01.2026	1.000.000	977.000,00	0,38
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026	1.500.000	1.463.250,00	0,57
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.25%/19-24.10.2029	1.000.000	940.000,00	0,37
CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 1%/19-07.11.2025	600.000	594.000,00	0,23
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.1637%/21-280428	1.000.000	941.500,00	0,37
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.25%/19-10.10.2029	2.500.000	2.312.500,00	0,91
CHF CREDIT SUISSE AG LONDON 0.55%/16-15.04.2024	3.500.000	3.498.600,00	1,37
CHF CREDIT SUISSE GUERNSEY BRANCH 3.1255%/10-12.11.2030	600.000	647.100,00	0,25
CHF DEUTSCHE BAHN 0.25%/21-27.10.2031	1.640.000	1.519.460,00	0,60
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.1%/19-19.06.2029	1.000.000	943.000,00	0,37

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermögens
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.1%/21-28.01.2036	3.000.000	2.595.000,00	1,02	CHF PROVINCE OF SASKATCHEWA 0.525%/22-010332	500.000	472.000,00	0,19
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.45%/17-08.11.2030	2.500.000	2.372.500,00	0,93	CHF RAIFFEISENLANDESBANK 2.63%/23-290628	1.500.000	1.538.250,00	0,60
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.5%/19-19.06.2034	1.470.000	1.354.605,00	0,53	CHF ROYAL BANK CANADA 2.445%/23-250128	1.500.000	1.545.000,00	0,61
CHF DEUTSCHE BAHN FIN 1.95%/22-210932	850.000	894.625,00	0,35	CHF ROYAL BANK OF CANADA 0.2%/21-220931	1.000.000	889.000,00	0,35
CHF DEUTSCHE TELEKOM AG 0.435%/20-06.02.2032	500.000	461.250,00	0,18	CHF ROYAL BANK OF CANADA 0.25%/21-151029	1.500.000	1.391.250,00	0,55
CHF DH SWITZERLAND FINANCE 1.125%/15-08.12.2028	500.000	494.500,00	0,19	CHF SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 0.15%/19-10.12.2024	1.000.000	990.300,00	0,39
CHF EDF 0.65%/16-13.10.2028	2.405.000	2.303.990,00	0,91	CHF SCNF RESEAU 3.25%/06-300632	750.000	859.875,00	0,34
CHF EIB 3.125%/06-300636	1.000.000	1.222.500,00	0,48	CHF SHELL INTL FINANCE 0.875%/15-210828	1.000.000	981.000,00	0,39
CHF ELI LILLY & CO 0.45%/16-24.05.2028	1.380.000	1.318.520,00	0,52	CHF SNCF RESEAU 2.625%/11-110337	500.000	569.000,00	0,22
CHF EUROHYPO 3.125%/06-14.07.2025	1.000.000	1.019.800,00	0,40	CHF SOCIETE GENERALE LTD 0.25%/20-25.02.2027	1.000.000	955.500,00	0,38
CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.17%/17-18.07.2025	750.000	737.400,00	0,29	CHF SOCIETE GENERALE SA 0.25%/19-08.10.2026	1.200.000	1.156.200,00	0,45
CHF FED CAISSES DES JARDINS 1.735%/23-310128	1.500.000	1.517.250,00	0,60	CHF SOCIETE GENERALE SA 2.625%/22-141026	1.500.000	1.537.500,00	0,60
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	3.500.000	3.314.500,00	1,30	CHF SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.227%/20-18.06.2030	2.500.000	2.332.500,00	0,92
EUR GLITNIR 0%/16-08.01.2030	128.445	312,36	0,00	CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025	1.500.000	1.467.000,00	0,58
CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.4%/21-110528	2.500.000	2.380.000,00	0,93	CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 2.7%/23-200329	800.000	823.200,00	0,32
CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025	1.955.000	1.937.405,00	0,76	CHF SVENSKA HANDELSBANKEN 1.25%/22-240527	1.000.000	994.500,00	0,39
CHF HSBC HOLDINGS PLC 1.805%/22-010626	1.200.000	1.197.000,00	0,47	CHF SWEDISH EXPORT CREDIT 1.7125%/23-170130	2.000.000	2.041.000,00	0,80
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029	1.750.000	1.574.125,00	0,62	CHF THE EXPORT IMPORT BANK OF KOREA 0%/19-27.05.2025	1.000.000	983.500,00	0,39
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/20-27.03.2030	2.000.000	1.778.000,00	0,70	CHF THERMO FISHER SCIENTIF 1.8401%/24-080332	1.000.000	1.017.500,00	0,40
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/21-230828	1.000.000	919.500,00	0,36	CHF TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 0.5%/15-01.06.2027	800.000	782.000,00	0,31
CHF INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0.25%/19-30.09.2024	1.400.000	1.389.640,00	0,55	CHF TRANSPOWER NEW ZEALAND 0.038%/21-160329	1.270.000	1.192.530,00	0,47
CHF KFW 2.5%/05-25.08.2025	5.000.000	5.091.500,00	2,00	CHF TRANSPOWER NEW ZEALAND LIMITED 0.02%/19-16.12.2027	500.000	476.750,00	0,19
CHF KOMMUNALBANKEN 1.275%/22-221227	2.000.000	2.006.000,00	0,79	CHF TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE 0.65%/16-02.11.2026	2.000.000	1.953.000,00	0,77
CHF KOMMUNEKREDIT 0%/21-030342	500.000	394.250,00	0,15	CHF UBS GROUP FUNDING T. 2 1.25%/16-23.02.2026	800.000	793.600,00	0,31
CHF KOMMUNEKREDIT 0.625%/15-09.07.2027	1.000.000	983.500,00	0,39	CHF VERIZON COMMUNICATIONS 0.1925%/21-240328	3.500.000	3.326.750,00	1,31
CHF KOMMUNEKREDIT 2.875%/06-13.10.2031	3.060.000	3.425.670,00	1,35	CHF VODAFONE GROUP 0.5%/16-19.09.2031	1.500.000	1.395.000,00	0,55
CHF LANDESBANK HESSEN 4.2425%/23-250733	1.500.000	1.568.250,00	0,62	CHF WESTPAC BANKING 2.0125%/23-130630	2.000.000	2.072.000,00	0,81
CHF LANDESBANK WUERTEMBERG 2.6025%/23-041028	1.500.000	1.531.500,00	0,60	CHF WESTPAC BANKING CORP 0.25%/19-29.01.2027	2.000.000	1.938.000,00	0,76
CHF LLOYDS BANK PLC 1.87%/23-310827	1.500.000	1.525.500,00	0,60	CHF WESTPAC BANKING CORP 0.3%/17-28.11.2025	500.000	491.000,00	0,19
CHF LLOYDS BANKING 0.6025%/22-09.02.2029	2.200.000	2.066.900,00	0,81	CHF WESTPAC BANKING CORP 0.5%/18-16.05.2028	500.000	481.250,00	0,19
CHF MANITOBA (PROVINCE OF) 0.25%/19-15.03.2029	2.500.000	2.380.000,00	0,93	Total Anleihen	247.137.842,36	97,08	
CHF MCDONALD'S 0.17%/16-04.10.2024	1.500.000	1.490.250,00	0,59	Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere	247.137.842,36	97,08	
CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027	3.000.000	2.865.000,00	1,13	Nicht börsennotierte Wertpapiere			
CHF MONDELEZ INTERNATIONAL 1.125%/15-30.12.2025	800.000	795.200,00	0,31	Anleihen			
CHF MUENCHENER HYPOTH EG 0.05%/21-130836	250.000	204.250,00	0,08	CHF BANK OF NOVA SCOTIA 2.3825%/23-220927	2.000.000	2.054.000,00	0,81
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028	2.500.000	2.343.750,00	0,92	CHF EMBOTELLADORA AN 2.7175%/23-200928	1.000.000	1.034.000,00	0,41
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 0.2%/19-18.06.2031	2.000.000	1.830.000,00	0,72	CHF LEHMAN BROTHERS HOLDINGS 2.5%/06-13.10.2010 (DEFAULTED)	12.000.000	105.000,00	0,04
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 0.25%/19-26.02.2029	1.250.000	1.185.000,00	0,47	Total Anleihen	3.193.000,00	1,25	
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 0.25%/21-290341	500.000	405.250,00	0,16	Nicht börsennotierte Wertpapiere	3.193.000,00	1,25	
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 0.3%/17-20.12.2024	1.150.000	1.139.880,00	0,45	Total des Wertpapierbestandes	250.330.842,36	98,33	
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 0.5%/18-14.06.2028	2.500.000	2.411.250,00	0,95	Bareinlagen bei Banken und Brokern	3.168.602,53	1,24	
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 0.55%/17-221132	500.000	467.000,00	0,18	Bankverbindlichkeiten und sonstige	-727,54	0,00	
CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	3.000.000	3.018.000,00	1,19	Anderer Nettovermögenswerte	1.084.799,47	0,43	
CHF MUNICIPALITY FINANCE PLC 0.625%/17-06083	300.000	274.500,00	0,11	Fondsvermögen	254.583.517,60	100,00	
CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.065%/20-29.01.2029	2.000.000	1.869.000,00	0,73				
CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.125%/19-21.06.2027	4.000.000	3.842.000,00	1,51				
CHF NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0%/19-11.07.2025	4.500.000	4.425.750,00	1,74				
CHF NATWEST MARKETS 2.7825%/22-061227	1.000.000	1.035.500,00	0,41				
CHF NATWEST MARKETS 2.8575%/23-060628	2.600.000	2.711.800,00	1,07				
CHF NEDERLANDSE WTRSCHPSBK 0.002%/21-040341	500.000	405.000,00	0,16				
CHF NESTLE HOLDINGS INC 0.55%/17-041032	1.000.000	937.000,00	0,37				
CHF NESTLE LTD. 2.5%/22-140734	2.500.000	2.756.250,00	1,08				
CHF NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.125%/20-11.09.2029	2.500.000	2.311.250,00	0,91				
CHF NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.25%/19-18.10.2027	2.500.000	2.393.750,00	0,94				
CHF NORDEA BANK ABP 0.125%/20-02.06.2026	500.000	485.750,00	0,19				
CHF NORDEA BANK ABP 1.81%/22-150627	2.400.000	2.413.200,00	0,95				
CHF NORDEA BANK ABP 2.49%/23-260528	2.200.000	2.269.300,00	0,89				
CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028	1.000.000	947.000,00	0,37				
CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025	2.000.000	1.975.200,00	0,78				
CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.55%/20-27.05.2033	2.000.000	1.840.000,00	0,72				
CHF OEKB 2.875%/05-25.02.2030	2.900.000	3.184.200,00	1,25				
CHF OEKB 3.25%/06-25.07.2036	1.000.000	1.222.500,00	0,48				
CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.25%/17-28.06.2029	3.000.000	2.845.500,00	1,12				
CHF PROVINCE OF MANITOBA 0.25%/19-150329	350.000	319.375,00	0,13				
CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/19-061239	300.000	248.100,00	0,10				
CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.2%/16-07.11.2031	2.500.000	2.292.500,00	0,90				
CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029	1.250.000	1.190.625,00	0,47				
CHF PROVINCE OF QUEBEC 2.04%/23-090533	2.000.000	2.120.000,00	0,83				

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Ungeprüfte Informationen

Vergütung

Diese Offenlegung sollte in Verbindung mit der Credit Suisse Vergütungspolitik (erhältlich auf der Website des Konzerns <https://www.credit-suisse.com/media/assets/about-us/docs/our-company/our-governance/compensation-policy.pdf>) gelesen werden, die ausführlich über die Grundsätze der Vergütungspolitik informiert.

Gesamtvergütung OGAW

Zum 31. Dezember 2023 verwaltete Credit Suisse Fund Management S.A., im Folgenden "CSFM", Vermögenswerte im Gesamtwert von CHF 37,9 Mia., von denen CHF 30,8 Mia. in OGAW angelegt waren. Die im Folgenden dargelegten Daten zur Bruttogesamtvergütung entsprechen den in Bezug auf die Wertentwicklung 2023 gezahlten Beträgen.

Mitarbeitervergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 entrichtet von CSFM an 30 Empfänger	CHF 4.349.067,63 bestehend aus: - CHF 3.751.890,69 feste Vergütung - CHF 597.176,93 variable Vergütung
<i>Umfasst:</i>	
Vergütung der Geschäftsleitung	CHF 1.493.947,69
Vergütung von Kontrollfunktionen	CHF 721.100,69
Vergütung an andere Mitarbeiter, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der verwalteten Fonds haben	k.A. (*)

(*) Um die Offenlegung von Vergütungsangaben zu einzelnen Mitarbeitern zu vermeiden, wird diese Kategorie unter der Kategorie "Kontrollfunktionen" zusammenfassend dargelegt.

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 entrichtet vom OGAW-Fonds an 0 Empfänger	CHF 0, bestehend aus: - CHF 0 feste Vergütung - CHF 0 variable Vergütung
<i>Umfasst:</i>	
Vergütung der Geschäftsleitung	CHF 0
Vergütung von Kontrollfunktionen	CHF 0
Vergütung an andere Mitarbeiter, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben	CHF 0

Die feste Vergütung besteht aus Verwaltungsratshonoraren, die an die Verwaltungsratsmitglieder gezahlt werden, einschliesslich Gehälter und Zuwendungen. Die variable Vergütung besteht aus jährlichen Bonuszahlungen, die gemäss der Vergütungspolitik gezahlt werden, einschliesslich der direkt vom Fonds an die Mitarbeiter entrichteten Vergütung, z. B. durch etwaige Performancegebühren.

Die jährlichen Bruttobeträge der festen und variablen Vergütung werden zusammenfassend dargelegt.

Die Umsetzung der Vergütungspolitik wird zumindest jährlich von der internen Revision hinsichtlich der Einhaltung der vom Verwaltungsrat von CSFM angenommenen Politik und Verfahren geprüft.

Vergütung von Vertretern für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024:

Credit Suisse Fund Management S.A. zahlt keine Vergütung an identifizierte Mitarbeiter von Vertretern (Tätigkeiten des Portfoliomanagements und des Risikomanagements).

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024, die vom OGAW an Vertreter (Tätigkeiten des Portfoliomanagements und des Risikomanagements) gezahlt wurde.	CHF 1.405.894,99 Bestehend aus: - CHF 1.405.894,99 Verwaltungsgebühren - CHF 0,00 Performancegebühren
--	---

Die Umsetzung der Vergütungspolitik wird zumindest jährlich von der internen Revision hinsichtlich der Einhaltung der vom Verwaltungsrat von CSFM angenommenen Politik und Verfahren geprüft.

Im Jahr 2023 wurden keine wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik vorgenommen.

Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")

Arten von SFT

Am 31.03.2024 war der Fonds an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

Wiederverwendung von Sicherheiten

Die Gesellschaft verwendet Sicherheiten im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften nicht wieder. Es erfolgte keine Wiederanlage von Barsicherheiten.

Verwahrung von Sicherheiten

Die Verwahrung von Sicherheiten erfolgt durch Credit Suisse (Luxembourg) S.A. (die "Depotbank"). Die aus der Wertpapierleihe erhaltenen Sicherheiten werden in einem Sammelkonto gehalten.

Abwicklung und Clearing

Die Abwicklung und das Clearing von Finanzierungstransaktionen für Wertpapiere erfolgt bilateral.

Fälligkeitstermin und Sicherheiten

Die Fälligkeit von SFTs ist stets unbefristet. Die Fälligkeit der verbundenen Sicherheiten wird im nachfolgenden Abschnitt ausgewiesen.

Ergänzende Informationen zu Wertpapierleihgeschäften

Zum 31.03.2024 partizipierten die Subfonds ausschließlich am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich (der „Principal“). Der Umfang von verliehenen Wertpapieren als Teil der gesamten verleihbaren Vermögenswerte, die gemäss Definition keine Barmittel und Barmitteläquivalente umfassen, und als Teil des Nettogesamtvermögens sind der nachfolgenden Tabelle zu entnehmen. Der Umfang des Vermögens, das in Wertpapierleihgeschäften gebunden ist, und Angaben zu Sicherheiten, Rendite und Kosten sind in den Erläuterungen dieses Berichts enthalten.

Subfonds	Währung	Umfang der verliehenen Wertpapiere als Anteil vom gesamten verleihbaren Vermögen (in %)*	Summe des Wertpapierleihgeschäftes im Vergleich zum Nettoinventarwert (%)
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	6,47	6,33
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	1,88	1,73
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	2,61	2,56
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	0,75	0,73

* ohne Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Daten zu Emittenten von Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte

Die aus Wertpapierleihgeschäften für alle von Credit Suisse Fund Management S.A verwalteten Fonds erhaltenen Sicherheiten werden in einem Sammelkonto gehalten und anteilmässig entsprechend ihrer Beteiligung an Wertpapierleihgeschäften zugewiesen.

Die zehn grössten Emittenten von Sicherheiten aus dem Sammelkonto sind in der untenstehenden Tabelle aufgeführt:

Sicherheitsemitter	Gesamtumfang der Sicherungswertpapiere und -rohstoffe, die pro Emittent auf Pool-Ebene erhalten wurden (in CHF)
US TREASURY	123.842.351,28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	99.560.670,69
BELGIUM KINGDOM	65.431.850,22
REPUBLIC OF AUSTRIA	59.274.806,52
FRANCE (GOVT OF)	55.595.941,91
EUROPEAN UNION	43.637.146,64
NETHERLANDS GOVERNMENT	37.041.486,98
PFANDBRIEF SCHWEIZ HYPO	36.241.731,84
EFSF	21.149.063,94
KFW	16.813.184,94

Prozentsatz der Sicherheiten auf dem Sicherheitensammelkonto, die von den jeweiligen Subfonds gehalten werden**Subfonds**

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	1,53%
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	0,50%
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	0,70%
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	0,30%

Restlaufzeit der Sicherheit im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften

Subfonds	Währung	Fälligkeit der Sicherheit					
		Weniger als 1 Woche	Weniger als 1 Monat	Von 1 Monat bis 3 Monate	Von 3 Monaten bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	105.068,82	246.472,83	284.000,99	2.489.913,20	6.937.026,68	443.135,29
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	33.423,80	78.406,31	90.344,52	792.074,77	2.206.761,20	140.967,28
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	51.752,65	121.402,55	139.887,40	1.226.430,52	3.416.898,72	218.270,52
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	19.745,28	46.318,92	53.371,47	467.922,09	1.303.655,09	83.277,12

Transparenz bei der Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen

Gemäss Artikel 11 (1) der Verordnung (EU) 2019/2088 (SFDR) geben Subfonds nach Artikel 8 an, inwieweit ökologische oder soziale Merkmale erfüllt werden. Produkte nach Artikel 9 der SFDR geben die Gesamtnachhaltigkeitswirkung des Subfonds an, belegt durch relevante Nachhaltigkeitsindikatoren.

Für Subfonds, die unter Artikel 8 oder 9 der SFDR fallen, sind die jeweiligen Informationen weiter unten auf Subfondsebene angegeben.

Subfonds, die nicht unter Artikel 8 oder 9 der SFDR fallen, sind weiter unten nicht aufgeführt. Die Anlagen, die diesen Subfonds zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

ANHANG IV

Vorlage – Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300MUJYK8BC6DGI48

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,25% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen.

Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Weitere Informationen zu ESG-Integration, ESG-Ausschlüssen und aktivem Aktionärstum finden Sie nachfolgend unter der Frage "Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?" und online auf www.credit-suisse.com/esg.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2024. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,20%, AA: 37,04%, A: 25,25%, BBB: 11,08%, BB: 2,85%, B: 2,13%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 1,52%, Keine Datenabdeckung**: 4,93%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,34	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,74	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,62	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 17,61%, Gelb: 31,06%, Orange: 40,92%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,71%, Keine Datenabdeckung**: 3,70%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 53,61%, Neutral: 40,03%, Negativ: 3,36%, Nicht bewertbar**: 1,48%, Keine Datenabdeckung**: 1,52%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus dem vorangehenden Bezugszeitraum (zum 31.03.2023). Die Daten können vom zuvor veröffentlichten Bericht abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 11,53%, AA: 42,28%, A: 24,12%, BBB: 10,95%, BB: 5,70%, B: 0,38%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: -0,12%, Keine Datenabdeckung**: 5,15%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,13	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,83	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,79	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 25,17%, Gelb: 28,70%, Orange: 36,20%, Rot: 1,13%, Nicht bewertbar**: 4,75%, Keine Datenabdeckung**: 4,05%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).

Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 55,21%, Neutral: 43,53%, Negativ: 0,64%, Nicht bewertbar**: 0,74%, Keine Datenabdeckung**: - 0,12%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	--	--

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Zum Ende des Bezugszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen zu einem der folgenden ökologischen und sozialen Ziele bei:

- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO₂-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.

Die vorstehenden Kriterien wurden anhand einer quantitativen Methode beurteilt. Soweit kein Ergebnis aus der quantitativen Beurteilung vorlag (z. B. bei fehlenden quantitativen ESG-Daten), wurden die Investitionen zur Bestätigung fallweise einer eigenen Beurteilung der Kriterien unterzogen. Diese Fälle wurden durch einen zentralen Ausschuss von Credit Suisse genehmigt.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt?

CSAM betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus ihrem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten.

— Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

1. keinen erheblichen negativen Beitrag zum Klimawandel leisten. Bei diesem Kriterium kommt ein Indikator zum Einsatz, der die grössten Emittenten von Treibhausgasen weltweit anzeigt und sich auf die PAI 1, 2, 3 und 15 bezieht.
2. keinen normen-, werte- und verhaltensbasierten Ausschlüssen und anderen Anlagebeschränkungen unterliegen, die sich auf die PAI 4, 10, 14 und 16 beziehen.
3. keinen schweren ESG-Kontroversen unterliegen, die sich gegebenenfalls auf die PAI 7 und 10 beziehen.
4. bei der ESG-Performance im Branchenvergleich nicht deutlich zurückliegen. Dieses Kriterium wurde angewendet, um die übrigen PAI so weit wie möglich abzudecken.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt. Unternehmen, die erhebliche Schwächen in ihrem Geschäftsverhalten aufweisen, insbesondere bezüglich der Verletzung der Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC), und Unternehmen, die auf der Beobachtungsliste stehen, aber noch nicht direkt ausgeschlossen wurden, werden als Unternehmen gekennzeichnet, die aufgrund der Verletzung des DNSH-Grundsatzes nicht als nachhaltige Investitionen im Sinne der SFDR gelten.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen PAI aus der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission. Die Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen werden als nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.04.2023 bis zum 31.03.2024 entsprechen.

Bitte beachten Sie, dass CSAM beschliessen kann oder unter Umständen nicht in der Lage ist, aufgrund der Anlagestrategie, der Anlageklasse oder der Verfügbarkeit von zuverlässigen Daten alle hier genannten PAI zu berücksichtigen und/oder abzuschwächen. Die Berücksichtigung von PAI kann angesichts der zunehmenden Verfügbarkeit und Qualität von Daten Änderungen unterliegen. Eine aktuelle Übersicht über die PAI, die auf Subfondsebene berücksichtigt werden, finden Sie im EET.

Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	12.612,99	97,21	86,46
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.132,17	97,21	86,46
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	114.894,59	97,21	86,46
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	129.760,02	97,21	86,46
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	555,03	97,21	86,46
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	887,39	97,21	95,02
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	12,27	97,21	93,39
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	47,51	97,21	74,04
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	97,21	0,00

6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	97,21	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,07	97,21	84,49
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,14	97,21	84,49
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	97,21	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	97,21	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	97,21	0,00
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	97,21	0,00
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	97,21	0,00
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	2,15	97,21	93,50
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,01	97,21	1,22
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,41	97,21	27,29
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,28	97,21	93,74
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	20,11	97,21	93,39
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	7,16	97,21	39,26
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	35,00	97,21	92,17
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	97,21	93,39
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	5,07	2,36	1,32
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	2,36	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	2,36	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

* Wirkung: Der Wert stellt das nicht normalisierte Exposure gegenüber einem bestimmten PAI-Indikator auf Portfolioebene dar. Dies bedeutet, dass für die PAI-Werte die tatsächlichen Gewichtungen der Portfolioengagements genutzt werden.

** Infrage kommende Vermögenswerte: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios (einschliesslich Liquidität), für den der PAI anwendbar ist. Beispielsweise können vom Fonds gehaltene Staatsanleihen nicht anhand von PAI-Indikatoren gemessen werden, die auf ein Unternehmen, in das investiert wird, angewendet werden.

*** Datenabdeckung: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios, für den Daten zu den PAI-Indikatoren verfügbar sind.

**** Kennzeichnet die Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind, einschliesslich Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von fossilen Brennstoffen.

***** Die Abdeckung des PAI 6 ist auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäss der SFDR beschränkt.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) / 0,250% / 15.02.2027	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,97	Deutschland
CREDIT AGRICOLE SA / 1,875% / 22.04.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,75	Frankreich
ENGIE SA / 1,375% / 27.03.2025	D. Energieversorgung	1,74	Frankreich
JPMORGAN CHASE & CO / 1,090% / 11.03.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,70	Vereinigte Staaten von Amerika
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV / 0,250% / 17.11.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,69	Italien
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP / 0,337% / 08.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,67	Japan
MORGAN STANLEY / 0,406% / 29.10.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,65	Vereinigte Staaten von Amerika
BARCLAYS PLC / 2,885% / 31.01.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,45	Vereinigtes Königreich
INFORMA PLC / 2,125% / 06.10.2025	J. Information und Kommunikation	1,44	Vereinigtes Königreich
Deutsche Bank AG / 1,000% / 19.11.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,44	Deutschland
AFRICA FINANCE CORP / 3,125% / 16.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,43	Afrika, supranational
BNP PARIBAS SA / 2,125% / 23.01.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,43	Frankreich
CAIXABANK SA / 1,375% / 19.06.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,41	Spanien
DANSKE BANK A/S / 1,375% / 17.02.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,40	Dänemark
DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC / 1,900% / 19.03.2027	J. Information und Kommunikation	1,40	Vereinigte Staaten von Amerika

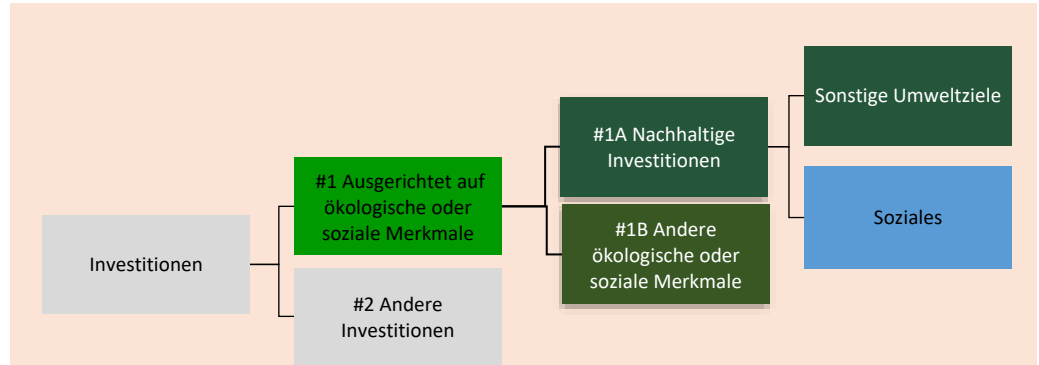
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren, noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Weitere Informationen finden Sie im Abschnitt "Welche Investitionen fielen unter 'Andere Investitionen', welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?"

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 97,00% seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 27,25 % seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 69,75 % seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 3,00 % seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	11,34%
D. Energieversorgung	4,69%
J. Information und Kommunikation	5,76%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	70,80%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,13%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,76%
Andere	1,52%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar. Die Kategorie "Andere" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Subfondsenagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,00%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	2,42%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	1,18%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	0,00%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und den Umstieg auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei

Kernenergie gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31.03.2024 meldete der Subfonds ein Engagement von 0,00 % in nachhaltigen Anlagen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel.

● *Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹ ?*

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission niedergelegt.

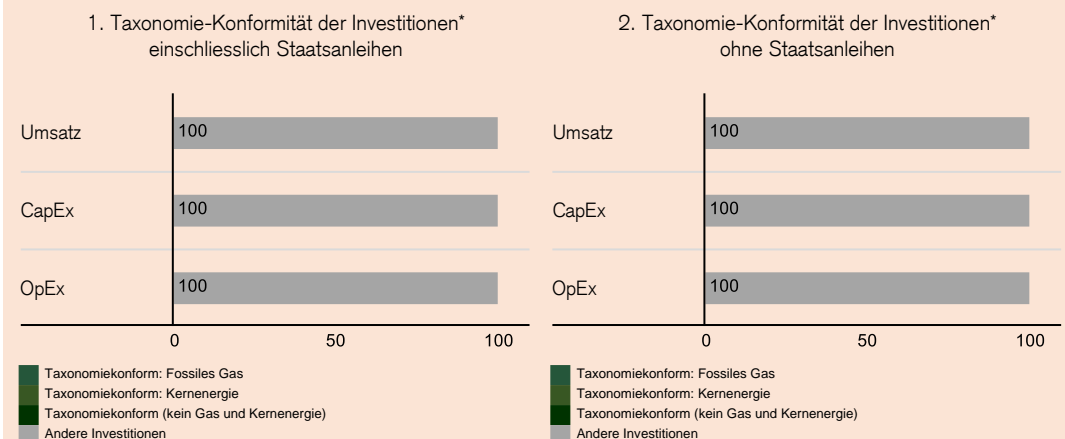
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Die berichtete EU-Taxonomie-Konformität des Subfonds war nicht Gegenstand einer Bestätigung oder einer Überprüfung durch einen Dritten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.03.2023 bei 0,00%.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Zum 31.03.2024 waren 25,81 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 1,44 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31.03.2024 waren 3,00 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

Anlagen wie z. B. Liquidität, Derivate und strukturierte Produkte können unter "Andere Investitionen" gefallen sein, da diese Instrumente nicht zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen dieses Subfonds beitrugen. Weitere Informationen über das Engagement des Portfolios in diesen Anlagen sind im Abschnitt Finanzen dieses Jahresberichts aufgeführt. Diese Anlagen hatten keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Sie wurden unter Umständen als Instrumente für die effiziente Portfolioverwaltung, für die Liquiditätssteuerung, für Absicherungszwecke oder als zusätzliche Renditequelle eingesetzt.

Darüber hinaus sind Anlagen unter Umständen unter "Andere Investitionen" gefallen, wenn unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Dies galt insbesondere für Anlageklassen, für die in unzureichender Weise ESG-Faktoren festgelegt wurden oder unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Soweit möglich, wurde auf diese zugrunde liegenden Wertpapiere ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewendet, indem die Beachtung der ESG-Ausschlüsse von CSAM sichergestellt wurde.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration sowie aktives Aktionärstum an.

Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die gegen internationale Verträge über umstrittene Waffen verstossen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielten. Er schloss Unternehmen aus, die mehr als 20% ihres Umsatzes aus dem Handel mit Tabakerzeugnissen und aus Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielten. Darüber hinaus wurde eine Umsatzgrenze von 20% für Investitionen in Kohle (Kohlebergbau und Kohleverstromung) angewendet.

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

Unternehmen, bei denen systematische Verstöße gegen internationale Standards festgestellt wurden und bei denen die Verstöße besonders schwerwiegend waren oder sich die Unternehmensleitung der Umsetzung notwendiger Reformen verschloss, wurden auf eine Beobachtungsliste gesetzt und konnten aus dem gesamten Anlageuniversum von Credit Suisse ausgeschlossen werden. Dieser Prozess wurde durch einen eigens eingerichteten Ausschuss gesteuert, der die Liste der ausgeschlossenen Unternehmen führte und für die zeitnahe Übermittlung der Liste an die Anlageteams zuständig war.

ESG-Faktoren wurden in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen helfen bei der Identifizierung von nachhaltigkeitsbezogenen Themen und Chancen, die sich wahrscheinlich auf die Finanzlage oder die betriebliche Leistung von Unternehmen in einer Branche auswirken werden.

- ESG-Wertpapieranalyse

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, berechneten die Anlageverwalter eine ESG-bereinigte Kreditansicht für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds, indem sie eine eigene Methode anwendeten, um systematisch das traditionelle Kreditrating des Emittenten mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes Kreditrating abzuleiten. Das ESG-bereinigte Kreditrating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung einen Vergleich von Wertpapieren auf ESG-bereinigter Basis und eine Beurteilung dessen, ob bestimmte Wertpapiere zum Portfolio hinzugefügt oder im Portfolio gehalten werden sollten. Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des zugrunde liegenden traditionellen Kreditratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung

Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden von den Anlageverwaltern im Bottom-up-Wertpapierausswahlprozess genutzt. Die Gewichtungen der Positionen ergaben sich aus Über- oder Untergewichtungen sowie dem Ausschluss von Wertpapieren auf Basis der ESG-bereinigten Kreditratings. In diesem Schritt kombinierten die Anlageverwalter ESG-bereinigte Kreditratings mit etablierten Instrumenten traditioneller Anlagestrategien, um fundiertere Anlageentscheidungen treffen zu können.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten täglich die ESG-Faktoren, um wesentliche Änderungen der ESG-Faktoren bei den zugrunde liegenden Wertpapieren zu erkennen, und nahmen eine regelmässige Neubeurteilung des Portfolios vor, um zu entscheiden, ob Positionen im Portfolio vergrössert oder verringert werden sollten.

- Mitwirkung

CSAM wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wurde, um seinen Einfluss auf Nachhaltigkeitsaspekte zu vergrössern. Auf ausgewählte Unternehmen, die imstande und bereit waren, Massnahmen zu ergreifen, wurde über Engagement eingewirkt, und CSAM war bestrebt, den Wert der Unternehmen, in die investiert wurde, durch Engagement zu erhalten und/oder zu steigern. Das Team für aktives Aktionärstum bestimmte die Themen und Probleme, die CSAM mit diesen Unternehmen erörtern wollte. Die daraus resultierenden Engagementaktivitäten für den Bezugszeitraum dieses SFDR-Anhangs zum Jahresbericht wurden mithilfe bestimmter Kriterien festgelegt und zielten auf Unternehmen ab, an denen die CSAM über ihre Fonds erhebliche Beteiligungen hielt. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Der Subfonds verwendete keinen Referenzwert für die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die erworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Keine Angaben.

ANHANG IV

Vorlage – Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300GNQ87SFC7GHR34

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,03% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen.

Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Weitere Informationen zu ESG-Integration, ESG-Ausschlüssen und aktivem Aktionärstum finden Sie nachfolgend unter der Frage "Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?" und online auf www.credit-suisse.com/esg.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2024. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 9,11%, AA: 41,76%, A: 22,02%, BBB: 9,14%, BB: 2,74%, B: 0,94%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 7,31%, Keine Datenabdeckung**: 6,98%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,22	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,85	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,83	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 37,71%, Gelb: 15,96%, Orange: 29,90%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 8,39%, Keine Datenabdeckung**: 8,05%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 49,79%, Neutral: 38,23%, Negativ: 3,58%, Nicht bewertbar**: 1,08%, Keine Datenabdeckung**: 7,31%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus dem vorangehenden Bezugszeitraum (zum 31.03.2023). Die Daten können vom zuvor veröffentlichten Bericht abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 9,70%, AA: 39,43%, A: 20,04%, BBB: 9,88%, BB: 3,13%, B: 0,29%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,04%, Keine Datenabdeckung**: 11,50%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,07	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,98	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,87	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 34,95%, Gelb: 19,18%, Orange: 27,19%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 12,23%, Keine Datenabdeckung**: 6,44%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).

Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 49,70%, Neutral: 37,57%, Negativ: 4,57%, Nicht bewertbar**: 1,96%, Keine Datenabdeckung**: 6,20%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	--	--

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Zum Ende des Bezugszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen zu einem der folgenden ökologischen Ziele bei:

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO₂-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.

Die vorstehenden Kriterien wurden anhand einer quantitativen Methode beurteilt. Soweit kein Ergebnis aus der quantitativen Beurteilung vorlag (z. B. bei fehlenden quantitativen ESG-Daten), wurden die Investitionen zur Bestätigung fallweise einer eigenen Beurteilung der Kriterien unterzogen. Diese Fälle wurden durch einen zentralen Ausschuss von Credit Suisse genehmigt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt?**

CSAM betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus ihrem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— — Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

1. keinen erheblichen negativen Beitrag zum Klimawandel leisten. Bei diesem Kriterium kommt ein Indikator zum Einsatz, der die grössten Emittenten von Treibhausgasen weltweit anzeigt und sich auf die PAI 1, 2, 3 und 15 bezieht.
2. keinen normen-, werte- und verhaltensbasierten Ausschlüssen und anderen Anlagebeschränkungen unterliegen, die sich auf die PAI 4, 10, 14 und 16 beziehen.
3. keinen schweren ESG-Kontroversen unterliegen, die sich gegebenenfalls auf die PAI 7 und 10 beziehen.
4. bei der ESG-Performance im Branchenvergleich nicht deutlich zurückliegen. Dieses Kriterium wurde angewendet, um die übrigen PAI so weit wie möglich abzudecken.

— — Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt. Unternehmen, die erhebliche Schwächen in ihrem Geschäftsverhalten aufweisen, insbesondere bezüglich der Verletzung der Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC), und Unternehmen, die auf der Beobachtungsliste stehen, aber noch nicht direkt ausgeschlossen wurden, werden als Unternehmen gekennzeichnet, die aufgrund der Verletzung des DNSH-Grundsatzes nicht als nachhaltige Investitionen im Sinne der SFDR gelten.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen PAI aus der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission. Die Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrössen für nachteilige Auswirkungen werden als nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.04.2023 bis zum 31.03.2024 entsprechen.

Bitte beachten Sie, dass CSAM beschliessen kann oder unter Umständen nicht in der Lage ist, aufgrund der Anlagestrategie, der Anlageklasse oder der Verfügbarkeit von zuverlässigen Daten alle hier genannten PAI zu berücksichtigen und/oder abzuschwächen. Die Berücksichtigung von PAI kann angesichts der zunehmenden Verfügbarkeit und Qualität von Daten Änderungen unterliegen. Eine aktuelle Übersicht über die PAI, die auf Subfondsebene berücksichtigt werden, finden Sie im EET.

Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
<i>Treibhausgasemissionen</i>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	663,82	90,07	67,63
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	633,82	90,07	67,63
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	22.877,10	90,07	67,63
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	24.177,10	90,07	67,63
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	110,42	90,07	67,63
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	467,03	90,07	83,83
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	2,02	90,07	84,71
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	41,26	90,07	64,76
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	0,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	73,56
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	90,07	73,56
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	0,00
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	0,00
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,07	73,56
<i>Biodiversität</i>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,55	90,07	83,49
<i>Wasser</i>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	90,07	0,47
<i>Abfall</i>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,06	90,07	13,42
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
<i>Soziales und Beschäftigung</i>			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	90,07	84,71
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	20,89	90,07	84,71

12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	6,86	90,07	34,81
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	30,54	90,07	82,67
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	90,07	84,71
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	1,48	4,22	1,30
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	4,22	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	4,22	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

* Wirkung: Der Wert stellt das nicht normalisierte Exposure gegenüber einem bestimmten PAI-Indikator auf Portfolioebene dar. Dies bedeutet, dass für die PAI-Werte die tatsächlichen Gewichtungen der Portfolioengagements genutzt werden.

** Infrage kommende Vermögenswerte: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios (einschliesslich Liquidität), für den der PAI anwendbar ist. Beispielsweise können vom Fonds gehaltene Staatsanleihen nicht anhand von PAI-Indikatoren gemessen werden, die auf ein Unternehmen, in das investiert wird, angewendet werden.

*** Datenabdeckung: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios, für den Daten zu den PAI-Indikatoren verfügbar sind.

**** Kennzeichnet die Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind, einschliesslich Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von fossilen Brennstoffen.

***** Die Abdeckung des PAI 6 ist auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäss der SFDR beschränkt.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMER / 0,050% / 15.10.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,85	Kanada
ABN AMRO BANK NV / 2,625% / 02.03.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,69	Niederlande
BNP PARIBAS SA / 1,750% / 05.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,67	Frankreich
ALPIQ HOLDING AG / 1,750% / 24.06.2026	D. Energieversorgung	1,66	Schweiz
KOREA HOUSING FINANCE CORP / 1,778% / 01.02.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,66	Korea, Republik
LLOYDS BANKING GROUP PLC / 1,000% / 04.03.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,64	Vereinigtes Königreich
BCO CREDITO INVS / 0,400% / 22.11.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,63	Chile
CBQ FINANCE LTD / 0,735% / 27.11.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,63	Katar
KOREA DEVELOPMENT BANK (THE) / 0,445% / 08.05.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,63	Korea, Republik
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT / 0,250% / 10.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,62	Frankreich
BARCLAYS PLC / 0,315% / 04.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,58	Vereinigtes Königreich
SCOTIABANK CHILE / 0,385% / 22.07.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,55	Kanada
EQUINIX EUROPE 1 FINANCING CORPORATION LLC / 2,875% / 12.09.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,47	Vereinigte Staaten von Amerika
ANZ NEW ZEALAND INTL LTD (LONDON BRANCH) / 0,350% / 22.10.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,47	Australien
RCI BANQUE / 3,500% / 10.05.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,19	Frankreich

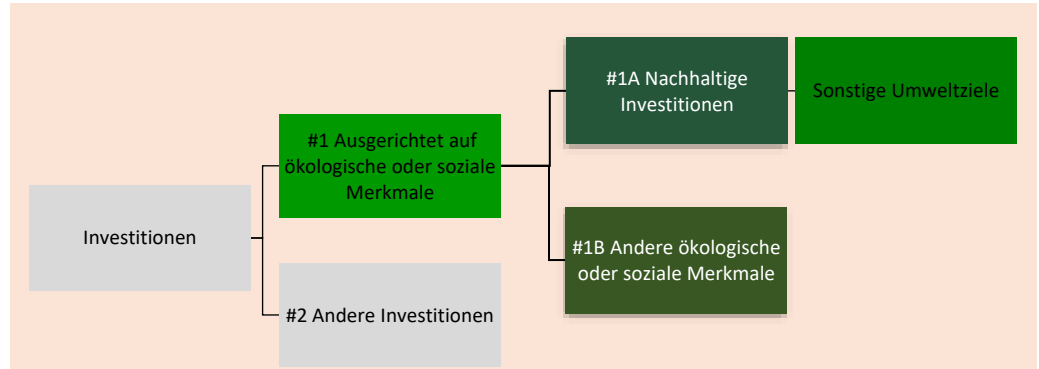
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren, noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Weitere Informationen finden Sie im Abschnitt "Welche Investitionen fielen unter 'Andere Investitionen', welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?"

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 91,61 % seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 21,03 % seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 70,58 % seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 8,39 % seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	3,64%
D. Energieversorgung	2,75%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,09%
I. Gastgewerbe	0,82%
J. Information und Kommunikation	5,77%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	75,31%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	1,61%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,82%
Andere	7,19%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar. Die Kategorie "Andere" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Subfondsenagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,00%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,00%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,00%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzeugnissen	0,00%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und den Umstieg auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei

Kernenergie gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31.03.2024 meldete der Subfonds ein Engagement von 0,00 % in nachhaltigen Anlagen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel.

● *Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹?*

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission niedergelegt.

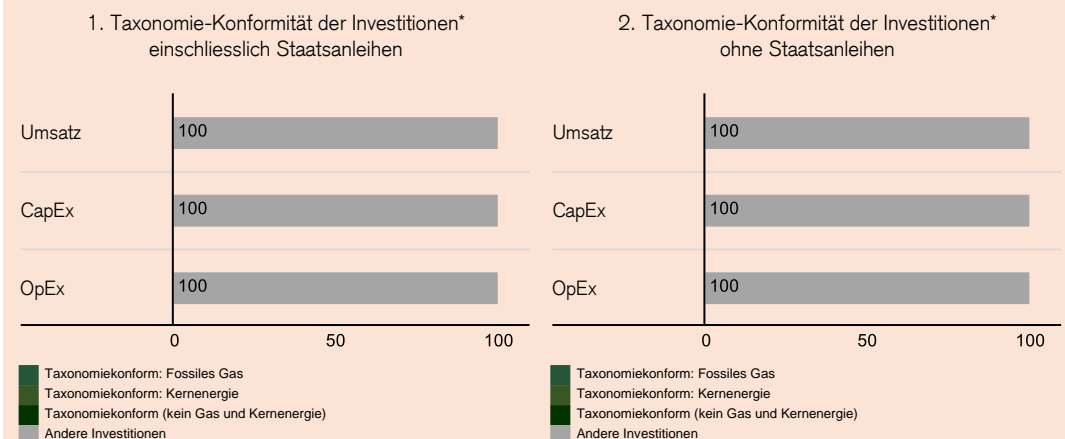
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Die berichtete EU-Taxonomie-Konformität des Subfonds war nicht Gegenstand einer Bestätigung oder einer Überprüfung durch einen Dritten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.03.2023 bei 0,00%.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Zum 31.03.2024 waren 21,03 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 0,00 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31.03.2024 waren 8,39 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

Anlagen wie z. B. Liquidität, Derivate und strukturierte Produkte können unter "Andere Investitionen" gefallen sein, da diese Instrumente nicht zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen dieses Subfonds beitrugen. Weitere Informationen über das Engagement des Portfolios in diesen Anlagen sind im Abschnitt Finanzen dieses Jahresberichts aufgeführt. Diese Anlagen hatten keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Sie wurden unter Umständen als Instrumente für die effiziente Portfolioverwaltung, für die Liquiditätssteuerung, für Absicherungszwecke oder als zusätzliche Renditequelle eingesetzt.

Darüber hinaus sind Anlagen unter Umständen unter "Andere Investitionen" gefallen, wenn unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Dies galt insbesondere für Anlageklassen, für die in unzureichender Weise ESG-Faktoren festgelegt wurden oder unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Soweit möglich, wurde auf diese zugrunde liegenden Wertpapiere ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewendet, indem die Beachtung der ESG-Ausschlüsse von CSAM sichergestellt wurde.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration sowie aktives Aktionärstum an.

Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die gegen internationale Verträge über umstrittene Waffen verstiesen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielten. Er schloss Unternehmen aus, die mehr als 20% ihres Umsatzes aus dem Handel mit Tabakerzeugnissen und aus Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielten. Darüber hinaus wurde eine Umsatzgrenze von 20% für Investitionen in Kohle (Kohlebergbau und Kohleverstromung) angewendet.

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

Unternehmen, bei denen systematische Verstöße gegen internationale Standards festgestellt wurden und bei denen die Verstöße besonders schwerwiegend waren oder sich die Unternehmensleitung der Umsetzung notwendiger Reformen verschloss, wurden auf eine Beobachtungsliste gesetzt und konnten aus dem gesamten Anlageuniversum von Credit Suisse ausgeschlossen werden. Dieser Prozess wurde durch einen eigens eingerichteten Ausschuss gesteuert, der die Liste der ausgeschlossenen Unternehmen führte und für die zeitnahe Übermittlung der Liste an die Anlageteams zuständig war.

ESG-Faktoren wurden in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen helfen bei der Identifizierung von nachhaltigkeitsbezogenen Themen und Chancen, die sich wahrscheinlich auf die Finanzlage oder die betriebliche Leistung von Unternehmen in einer Branche auswirken werden.

- ESG-Wertpapieranalyse

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, berechneten die Anlageverwalter eine ESG-bereinigte Kreditansicht für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds, indem sie eine eigene Methode anwendeten, um systematisch das traditionelle Kreditrating des Emittenten mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes Kreditrating abzuleiten. Das ESG-bereinigte Kreditrating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung einen Vergleich von Wertpapieren auf ESG-bereinigter Basis und eine Beurteilung dessen, ob bestimmte Wertpapiere zum Portfolio hinzugefügt oder im Portfolio gehalten werden sollten. Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des zugrunde liegenden traditionellen Kreditratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung

Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden von den Anlageverwaltern im Bottom-up-Wertpapierausswahlprozess genutzt. Die Gewichtungen der Positionen ergaben sich aus Über- oder Untergewichtungen sowie dem Ausschluss von Wertpapieren auf Basis der ESG-bereinigten Kreditratings. In diesem Schritt kombinierten die Anlageverwalter ESG-bereinigte Kreditratings mit etablierten Instrumenten traditioneller Anlagestrategien, um fundiertere Anlageentscheidungen treffen zu können.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten täglich die ESG-Faktoren, um wesentliche Änderungen der ESG-Faktoren bei den zugrunde liegenden Wertpapieren zu erkennen, und nahmen eine regelmässige Neubeurteilung des Portfolios vor, um zu entscheiden, ob Positionen im Portfolio vergrössert oder verringert werden sollten.

- Mitwirkung

CSAM wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wurde, um seinen Einfluss auf Nachhaltigkeitsaspekte zu vergrössern. Auf ausgewählte Unternehmen, die imstande und bereit waren, Massnahmen zu ergreifen, wurde über Engagement eingewirkt, und CSAM war bestrebt, den Wert der Unternehmen, in die investiert wurde, durch Engagement zu erhalten und/oder zu steigern. Das Team für aktives Aktionärstum bestimmte die Themen und Probleme, die CSAM mit diesen Unternehmen erörtern wollte. Die daraus resultierenden Engagementaktivitäten für den Bezugszeitraum dieses SFDR-Anhangs zum Jahresbericht wurden mithilfe bestimmter Kriterien festgelegt und zielten auf Unternehmen ab, an denen die CSAM über ihre Fonds erhebliche Beteiligungen hielt. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Der Subfonds verwendete keinen Referenzwert für die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Keine Angaben.

ANHANG IV

Vorlage – Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300XTAJVSK80V2877

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 23,29% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen.

Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Weitere Informationen zu ESG-Integration, ESG-Ausschlüssen und aktivem Aktionärstum finden Sie nachfolgend unter der Frage "Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?" und online auf www.credit-suisse.com/esg.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2024. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 7,42%, AA: 37,63%, A: 33,82%, BBB: 10,31%, BB: 5,67%, B: 1,05%, CCC: 1,77%, Nicht bewertbar**: 0,89%, Keine Datenabdeckung**: 1,44%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,18	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,67	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,45	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 16,89%, Gelb: 28,36%, Orange: 49,00%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,31%, Keine Datenabdeckung**: 1,44%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 45,05%, Neutral: 51,24%, Negativ: 2,82%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 0,89%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus dem vorangehenden Bezugszeitraum (zum 31.03.2023). Die Daten können vom zuvor veröffentlichten Bericht abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 6,37%, AA: 32,40%, A: 39,50%, BBB: 12,45%, BB: 4,73%, B: 3,09%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: -0,12%, Keine Datenabdeckung**: 1,59%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,76	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,94	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,52	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 24,39%, Gelb: 22,10%, Orange: 40,92%, Rot: 0,31%, Nicht bewertbar**: 10,69%, Keine Datenabdeckung**: 1,59%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).

Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 38,76%, Neutral: 55,96%, Negativ: 3,62%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 1,66%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	--	--

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Zum Ende des Bezugszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen zu einem der folgenden ökologischen und sozialen Ziele bei:

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO₂-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.

Die vorstehenden Kriterien wurden anhand einer quantitativen Methode beurteilt. Soweit kein Ergebnis aus der quantitativen Beurteilung vorlag (z. B. bei fehlenden quantitativen ESG-Daten), wurden die Investitionen zur Bestätigung fallweise einer eigenen Beurteilung der Kriterien unterzogen. Diese Fälle wurden durch einen zentralen Ausschuss von Credit Suisse genehmigt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt?**

CSAM betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus ihrem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

1. keinen erheblichen negativen Beitrag zum Klimawandel leisten. Bei diesem Kriterium kommt ein Indikator zum Einsatz, der die grössten Emittenten von Treibhausgasen weltweit anzeigt und sich auf die PAI 1, 2, 3 und 15 bezieht.
2. keinen normen-, werte- und verhaltensbasierten Ausschlüssen und anderen Anlagebeschränkungen unterliegen, die sich auf die PAI 4, 10, 14 und 16 beziehen.
3. keinen schweren ESG-Kontroversen unterliegen, die sich gegebenenfalls auf die PAI 7 und 10 beziehen.
4. bei der ESG-Performance im Branchenvergleich nicht deutlich zurückliegen. Dieses Kriterium wurde angewendet, um die übrigen PAI so weit wie möglich abzudecken.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt. Unternehmen, die erhebliche Schwächen in ihrem Geschäftsverhalten aufweisen, insbesondere bezüglich der Verletzung der Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC), und Unternehmen, die auf der Beobachtungsliste stehen, aber noch nicht direkt ausgeschlossen wurden, werden als Unternehmen gekennzeichnet, die aufgrund der Verletzung des DNSH-Grundsatzes nicht als nachhaltige Investitionen im Sinne der SFDR gelten.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen PAI aus der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission. Die Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrössen für nachteilige Auswirkungen werden als nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.04.2023 bis zum 31.03.2024 entsprechen.

Bitte beachten Sie, dass CSAM beschliessen kann oder unter Umständen nicht in der Lage ist, aufgrund der Anlagestrategie, der Anlageklasse oder der Verfügbarkeit von zuverlässigen Daten alle hier genannten PAI zu berücksichtigen und/oder abzuschwächen. Die Berücksichtigung von PAI kann angesichts der zunehmenden Verfügbarkeit und Qualität von Daten Änderungen unterliegen. Eine aktuelle Übersicht über die PAI, die auf Subfondsebene berücksichtigt werden, finden Sie im EET.

Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
<i>Treibhausgasemissionen</i>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	6.674,10	94,96	89,86
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.391,20	94,96	89,86
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	101.138,80	94,96	89,86
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	110.282,56	94,96	89,86
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	396,19	94,96	89,69
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	775,09	94,96	94,60
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	10,60	94,96	93,42
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	40,89	94,96	66,89
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,96	0,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,96	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,07	94,96	77,41
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	94,96	77,41
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,96	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,96	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,96	77,41
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	94,96	77,41
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,96	77,41
<i>Biodiversität</i>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,87	94,96	93,65
<i>Wasser</i>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	94,96	0,18
<i>Abfall</i>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	5,54	94,96	22,28
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
<i>Soziales und Beschäftigung</i>			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,32	94,96	93,65
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	30,34	94,96	93,42

12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	7,16	94,96	33,68
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	32,23	94,96	92,19
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	94,96	93,42
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	10,56	4,67	3,54
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	4,67	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	4,67	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

* Wirkung: Der Wert stellt das nicht normalisierte Exposure gegenüber einem bestimmten PAI-Indikator auf Portfolioebene dar. Dies bedeutet, dass für die PAI-Werte die tatsächlichen Gewichtungen der Portfolioengagements genutzt werden.

** Infrage kommende Vermögenswerte: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios (einschliesslich Liquidität), für den der PAI anwendbar ist. Beispielsweise können vom Fonds gehaltene Staatsanleihen nicht anhand von PAI-Indikatoren gemessen werden, die auf ein Unternehmen, in das investiert wird, angewendet werden.

*** Datenabdeckung: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios, für den Daten zu den PAI-Indikatoren verfügbar sind.

**** Kennzeichnet die Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind, einschliesslich Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von fossilen Brennstoffen.

***** Die Abdeckung des PAI 6 ist auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäss der SFDR beschränkt.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
UBS GROUP AG / 4,488% / 12.05.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,10	Schweiz
CREDIT AGRICOLE SA (LONDON BRANCH) / 1,907% / 16.06.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,01	Frankreich
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE / 0,855% / 12.02.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,01	Vereinigte Staaten von Amerika
T-MOBILE USA INC / 2,250% / 15.02.2026	J. Information und Kommunikation	1,99	Deutschland
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO / 1,750% / 01.04.2026	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,96	Vereinigte Staaten von Amerika
DEUTSCHE BANK AG (NEW YORK BRANCH) / 3,961% / 26.11.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,83	Deutschland
WELLS FARGO & COMPANY 3,908% / 25.04.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,83	Vereinigte Staaten von Amerika
ING GROEP NV / 3,869% / 28.03.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,80	Niederlande
AFRICA FINANCE CORP / 3,125% / 16.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,78	Afrika, supranational
JPMORGAN CHASE & CO / 1,040% / 04.02.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,70	Vereinigte Staaten von Amerika
BPCE SA / 6,612% / 19.10.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,65	Frankreich
TORONTO-DOMINION BANK/THE / 5,532% / 17.07.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,60	Kanada
ABN AMRO BANK NV / 4,750% / 28.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,56	Niederlande
FIRST ABU DHABI BANK PJSC / 0,125% / 16.02.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,56	Vereinigte Arabische Emirate
BROADCOM INC / 3,150% / 15.11.2025	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,54	Vereinigte Staaten von Amerika

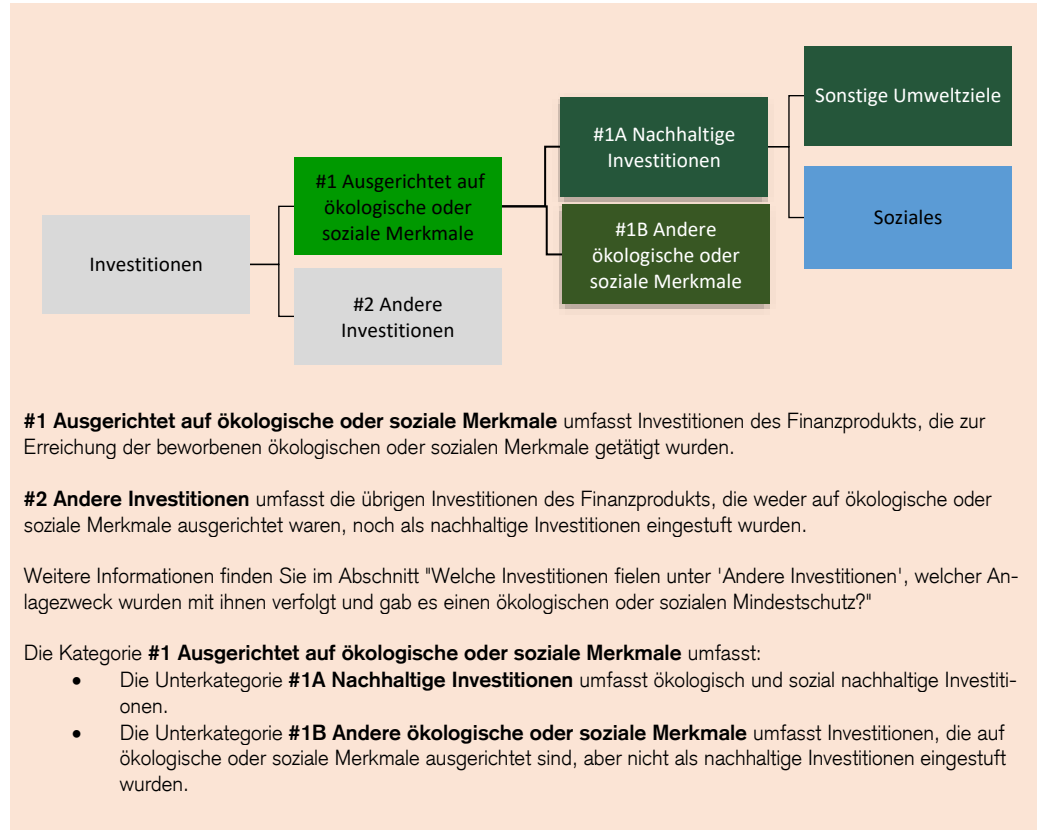
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 99,11 % seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 23,29 % seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 75,82 % seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 0,89 % seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	12,10%
D. Energieversorgung	0,83%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,01%
H. Verkehr und Lagerei	0,73%
J. Information und Kommunikation	6,75%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	67,95%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	0,99%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,97%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,64%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	2,11%
Andere	1,93%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar. Die Kategorie "Andere" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Subfondsenagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,00%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,00%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,83%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzeugnissen	0,00%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und den Umstieg auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31.03.2024 meldete der Subfonds ein Engagement von 0,00 % in nachhaltigen Anlagen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel.

● *Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹ ?*

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission niedergelegt.

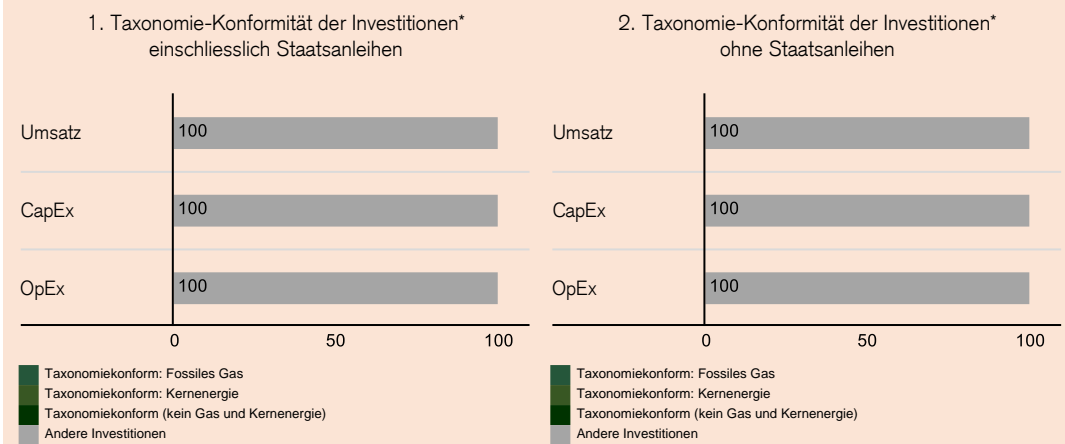
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Die berichtete EU-Taxonomie-Konformität des Subfonds war nicht Gegenstand einer Bestätigung oder einer Überprüfung durch einen Dritten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.03.2023 bei 0,00%.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Zum 31.03.2024 waren 22,32 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 0,97 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31.03.2024 waren 0,89 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

Anlagen wie z. B. Liquidität, Derivate und strukturierte Produkte können unter "Andere Investitionen" gefallen sein, da diese Instrumente nicht zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen dieses Subfonds beitrugen. Weitere Informationen über das Engagement des Portfolios in diesen Anlagen sind im Abschnitt Finanzen dieses Jahresberichts aufgeführt. Diese Anlagen hatten keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Sie wurden unter Umständen als Instrumente für die effiziente Portfolioverwaltung, für die Liquiditätssteuerung, für Absicherungszwecke oder als zusätzliche Renditequelle eingesetzt.

Darüber hinaus sind Anlagen unter Umständen unter "Andere Investitionen" gefallen, wenn unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Dies galt insbesondere für Anlageklassen, für die in unzureichender Weise ESG-Faktoren festgelegt wurden oder unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Soweit möglich, wurde auf diese zugrunde liegenden Wertpapiere ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewendet, indem die Beachtung der ESG-Ausschlüsse von CSAM sichergestellt wurde.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration sowie aktives Aktionärstum an.

Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die gegen internationale Verträge über umstrittene Waffen verstossen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielten. Er schloss Unternehmen aus, die mehr als 20% ihres Umsatzes aus dem Handel mit Tabakerzeugnissen und aus Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielten. Darüber hinaus wurde eine Umsatzgrenze von 20% für Investitionen in Kohle (Kohlebergbau und Kohleverstromung) angewendet.

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

Unternehmen, bei denen systematische Verstöße gegen internationale Standards festgestellt wurden und bei denen die Verstöße besonders schwerwiegend waren oder sich die Unternehmensleitung der Umsetzung notwendiger Reformen verschloss, wurden auf eine Beobachtungsliste gesetzt und konnten aus dem gesamten Anlageuniversum von Credit Suisse ausgeschlossen werden. Dieser Prozess wurde durch einen eigens eingerichteten Ausschuss gesteuert, der die Liste der ausgeschlossenen Unternehmen führte und für die zeitnahe Übermittlung der Liste an die Anlageteams zuständig war.

ESG-Faktoren wurden in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen helfen bei der Identifizierung von nachhaltigkeitsbezogenen Themen und Chancen, die sich wahrscheinlich auf die Finanzlage oder die betriebliche Leistung von Unternehmen in einer Branche auswirken werden.

- ESG-Wertpapieranalyse

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, berechneten die Anlageverwalter eine ESG-bereinigte Kreditansicht für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds, indem sie eine eigene Methode anwendeten, um systematisch das traditionelle Kreditrating des Emittenten mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes Kreditrating abzuleiten. Das ESG-bereinigte Kreditrating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung einen Vergleich von Wertpapieren auf ESG-bereinigter Basis und eine Beurteilung dessen, ob bestimmte Wertpapiere zum Portfolio hinzugefügt oder im Portfolio gehalten werden sollten. Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des zugrunde liegenden traditionellen Kreditratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung

Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden von den Anlageverwaltern im Bottom-up-Wertpapierausswahlprozess genutzt. Die Gewichtungen der Positionen ergaben sich aus Über- oder Untergewichtungen sowie dem Ausschluss von Wertpapieren auf Basis der ESG-bereinigten Kreditratings. In diesem Schritt kombinierten die Anlageverwalter ESG-bereinigte Kreditratings mit etablierten Instrumenten traditioneller Anlagestrategien, um fundiertere Anlageentscheidungen treffen zu können.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten täglich die ESG-Faktoren, um wesentliche Änderungen der ESG-Faktoren bei den zugrunde liegenden Wertpapieren zu erkennen, und nahmen eine regelmässige Neubeurteilung des Portfolios vor, um zu entscheiden, ob Positionen im Portfolio vergrössert oder verringert werden sollten.

- Mitwirkung

CSAM wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wurde, um seinen Einfluss auf Nachhaltigkeitsaspekte zu vergrössern. Auf ausgewählte Unternehmen, die imstande und bereit waren, Massnahmen zu ergreifen, wurde über Engagement eingewirkt, und CSAM war bestrebt, den Wert der Unternehmen, in die investiert wurde, durch Engagement zu erhalten und/oder zu steigern. Das Team für aktives Aktionärstum bestimmte die Themen und Probleme, die CSAM mit diesen Unternehmen erörtern wollte. Die daraus resultierenden Engagementaktivitäten für den Bezugszeitraum dieses SFDR-Anhangs zum Jahresbericht wurden mithilfe bestimmter Kriterien festgelegt und zielten auf Unternehmen ab, an denen die CSAM über ihre Fonds erhebliche Beteiligungen hielt. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Der Subfonds verwendete keinen Referenzwert für die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Keine Angaben.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Keine Angaben.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Keine Angaben.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Keine Angaben.

ANHANG IV

Vorlage – Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): UOEKF78I2YA2ISJ3Q773

Seit dem 18.03.2024 liquidiert.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen.

Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Weitere Informationen zu ESG-Integration, ESG-Ausschlüssen und aktivem Aktionärstum finden Sie nachfolgend unter der Frage "Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?" und online auf www.credit-suisse.com/esg.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus dem vorangehenden Bezugszeitraum (zum 31.03.2023). Die Daten können vom zuvor veröffentlichten Bericht abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 11,36%, AA: 36,25%, A: 26,76%, BBB: 8,10%, BB: 7,66%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 3,73%, Keine Datenabdeckung**: 6,13%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,98	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Soziales	4,84	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,96	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 27,96%, Gelb: 22,09%, Orange: 32,69%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 9,56%, Keine Datenabdeckung**: 7,69%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 49,43%, Neutral: 46,19%, Negativ: 1,32%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 3,06%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt?**

— — Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Keine Angaben

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Keine Angaben

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.

Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der grösste Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

31.03.2024



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und den Umstieg auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.

● *Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹?*

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

● *Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?*

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission niedergelegt.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.



Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Subfonds wurde zum 18.03.2024 liquidiert.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration sowie aktives Aktionärstum an.

Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die gegen internationale Verträge über umstrittene Waffen verstossen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielten. Er schloss Unternehmen aus, die mehr als 20% ihres Umsatzes aus dem Handel mit Tabakerzeugnissen und aus Hilfssystemen und Dienstleistungen für

konventionelle Waffen erzielen. Darüber hinaus wurde eine Umsatzgrenze von 20% für Investitionen in Kohle (Kohlebergbau und Kohleverstromung) angewendet.

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

Unternehmen, bei denen systematische Verstöße gegen internationale Standards festgestellt wurden und bei denen die Verstöße besonders schwerwiegend waren oder sich die Unternehmensleitung der Umsetzung notwendiger Reformen verschloss, wurden auf eine Beobachtungsliste gesetzt und konnten aus dem gesamten Anlageuniversum von Credit Suisse ausgeschlossen werden. Dieser Prozess wurde durch einen eigens eingerichteten Ausschuss gesteuert, der die Liste der ausgeschlossenen Unternehmen führte und für die zeitnahe Übermittlung der Liste an die Anlageteams zuständig war.

ESG-Faktoren wurden in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen helfen bei der Identifizierung von nachhaltigkeitsbezogenen Themen und Chancen, die sich wahrscheinlich auf die Finanzlage oder die betriebliche Leistung von Unternehmen in einer Branche auswirken werden.

- ESG-Wertpapieranalyse

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, berechneten die Anlageverwalter eine ESG-bereinigte Kreditansicht für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds, indem sie eine eigene Methode anwendeten, um systematisch das traditionelle Kreditrating des Emittenten mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes Kreditrating abzuleiten. Das ESG-bereinigte Kreditrating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung einen Vergleich von Wertpapieren auf ESG-bereinigter Basis und eine Beurteilung dessen, ob bestimmte Wertpapiere zum Portfolio hinzugefügt oder im Portfolio gehalten werden sollten. Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des zugrunde liegenden traditionellen Kreditratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden von den Anlageverwaltern im Bottom-up-Wertpapierauswahlprozess genutzt. Die Gewichtungen der Positionen ergaben sich aus Über- oder Untergewichtungen sowie dem Ausschluss von Wertpapieren auf Basis der ESG-bereinigten Kreditratings. In diesem Schritt kombinierten die Anlageverwalter ESG-bereinigte Kreditratings mit etablierten Instrumenten traditioneller Anlagestrategien, um fundiertere Anlageentscheidungen treffen zu können.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten täglich die ESG-Faktoren, um wesentliche Änderungen der ESG-Faktoren bei den zugrunde liegenden Wertpapieren zu erkennen, und nahmen eine regelmässige Neubeurteilung des Portfolios vor, um zu entscheiden, ob Positionen im Portfolio vergrössert oder verringert werden sollten.

- Mitwirkung

CSAM wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wurde, um seinen Einfluss auf Nachhaltigkeitsaspekte zu vergrössern. Auf ausgewählte Unternehmen, die imstande und bereit waren, Massnahmen zu ergreifen, wurde über Engagement eingewirkt, und CSAM war bestrebt, den Wert der Unternehmen, in die investiert wurde, durch Engagement zu erhalten und/oder zu steigern. Das Team für aktives Aktionärstum bestimmte die Themen und Probleme, die CSAM mit diesen Unternehmen erörtern wollte. Die daraus resultierenden Engagementaktivitäten für den Bezugszeitraum dieses SFDR-Anhangs zum Jahresbericht wurden mithilfe bestimmter Kriterien festgelegt und zielten auf Unternehmen ab, an denen die CSAM über ihre Fonds erhebliche Beteiligungen hielt. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Der Subfonds verwendete keinen Referenzwert für die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die erworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

Keine Angaben.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Keine Angaben.

ANHANG IV

Vorlage – Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): Z06LKJMJQL1LACKX1P67

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,35% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen.

Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Weitere Informationen zu ESG-Integration, ESG-Ausschlüssen und aktivem Aktionärstum finden Sie nachfolgend unter der Frage "Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?" und online auf www.credit-suisse.com/esg.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2024. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 11,35%, AA: 43,21%, A: 33,69%, BBB: 6,23%, BB: 1,94%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 1,09%, Keine Datenabdeckung**: 2,50%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,25	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,88	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,15	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 40,16%, Gelb: 20,45%, Orange: 26,15%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,41%, Keine Datenabdeckung**: 6,83%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%

ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 54,55%, Neutral: 44,33%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,01%, Keine Datenabdeckung**: 1,11%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus dem vorangehenden Bezugszeitraum (zum 31.03.2023). Die Daten können vom zuvor veröffentlichten Bericht abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren durchgehend während des Bezugszeitraums überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Weitere Informationen über die Quellen der Daten und die angewendeten Methoden für jeden Nachhaltigkeitsindikator finden Sie auf: www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 10,22%, AA: 40,17%, A: 30,60%, BBB: 9,45%, BB: 5,24%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 1,17%, Keine Datenabdeckung**: 3,15%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,85	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,94	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,17	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 41,60%, Gelb: 20,80%, Orange: 22,17%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,90%, Keine Datenabdeckung**: 8,52%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 50,39%, Neutral: 48,41%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,03%, Keine Datenabdeckung**: 1,17%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

* Für keinen der Nachhaltigkeitsindikatoren wurde durch einen Wirtschaftsprüfer eine Bestätigung abgegeben oder eine Überprüfung durch einen Dritten durchgeführt.

** Diese Kategorien können einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Bitte beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Subfonds abhängt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Zum Ende des Bezugszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen zu einem der folgenden ökologischen und sozialen Ziele bei:

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO₂-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.

Die vorstehenden Kriterien wurden anhand einer quantitativen Methode beurteilt. Soweit kein Ergebnis aus der quantitativen Beurteilung vorlag (z. B. bei fehlenden quantitativen ESG-Daten), wurden die Investitionen zur Bestätigung fallweise einer eigenen Beurteilung der Kriterien unterzogen. Diese Fälle wurden durch einen zentralen Ausschuss von Credit Suisse genehmigt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt?**

CSAM betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus ihrem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten.

— — — **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Während des Bezugszeitraums umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

1. keinen erheblichen negativen Beitrag zum Klimawandel leisten. Bei diesem Kriterium kommt ein Indikator zum Einsatz, der die grössten Emittenten von Treibhausgasen weltweit anzeigt und sich auf die PAI 1, 2, 3 und 15 bezieht.
2. keinen normen-, werte- und verhaltensbasierten Ausschlüssen und anderen Anlagebeschränkungen unterliegen, die sich auf die PAI 4, 10, 14 und 16 beziehen.
3. keinen schweren ESG-Kontroversen unterliegen, die sich gegebenenfalls auf die PAI 7 und 10 beziehen.
4. bei der ESG-Performance im Branchenvergleich nicht deutlich zurückliegen. Dieses Kriterium wurde angewendet, um die übrigen PAI so weit wie möglich abzudecken.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt. Unternehmen, die erhebliche Schwächen in ihrem Geschäftsverhalten aufweisen, insbesondere bezüglich der Verletzung der Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC), und Unternehmen, die auf der Beobachtungsliste stehen, aber noch nicht direkt ausgeschlossen wurden, werden als Unternehmen gekennzeichnet, die aufgrund der Verletzung des DNSH-Grundsatzes nicht als nachhaltige Investitionen im Sinne der SFDR gelten.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen PAI aus der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission. Die Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen werden als nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.04.2023 bis zum 31.03.2024 entsprechen.

Bitte beachten Sie, dass CSAM beschliessen kann oder unter Umständen nicht in der Lage ist, aufgrund der Anlagestrategie, der Anlageklasse oder der Verfügbarkeit von zuverlässigen Daten alle hier genannten PAI zu berücksichtigen und/oder abzuschwächen. Die Berücksichtigung von PAI kann angesichts der zunehmenden Verfügbarkeit und Qualität von Daten Änderungen unterliegen. Eine aktuelle Übersicht über die PAI, die auf Subfondsebene berücksichtigt werden, finden Sie im EET.

Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1.440,56	79,51	51,12
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	361,82	79,51	51,12
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	21.994,71	79,51	51,12
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	23.776,86	79,51	51,12
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	81,57	79,51	51,12
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	527,76	79,51	75,23
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	3,28	79,51	75,93
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	36,86	79,51	55,40
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,51	0,00

6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,51	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	79,51	65,17
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	79,51	65,17
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,51	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,51	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,51	0,00
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,51	65,17
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,51	0,00
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,70	79,51	76,22
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	79,51	0,00
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,03	79,51	7,59
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	79,51	76,38
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	16,19	79,51	75,93
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	5,26	79,51	25,55
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	27,87	79,51	72,20
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	79,51	76,38
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	2,70	19,87	1,86
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	19,87	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	19,87	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

* Wirkung: Der Wert stellt das nicht normalisierte Exposure gegenüber einem bestimmten PAI-Indikator auf Portfolioebene dar. Dies bedeutet, dass für die PAI-Werte die tatsächlichen Gewichtungen der Portfolioengagements genutzt werden.

** Infrage kommende Vermögenswerte: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios (einschliesslich Liquidität), für den der PAI anwendbar ist. Beispielsweise können vom Fonds gehaltene Staatsanleihen nicht anhand von PAI-Indikatoren gemessen werden, die auf ein Unternehmen, in das investiert wird, angewendet werden.

*** Datenabdeckung: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios, für den Daten zu den PAI-Indikatoren verfügbar sind.

**** Kennzeichnet die Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind, einschliesslich Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von fossilen Brennstoffen.

***** Die Abdeckung des PAI 6 ist auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäss der SFDR beschränkt.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
KFW / 2,500% / 25.08.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,03	Deutschland
BNG BANK NV / 2,500% / 21.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,03	Niederlande
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY / 11.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,74	Vereinigtes Königreich
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD / 0,125% / 21.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,51	Australien
CITIGROUP INC / 0,750% / 02.04.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,40	Vereinigte Staaten von Amerika
CREDIT SUISSE AG (LONDON BRANCH) / 0,550% / 15.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,38	Schweiz
KOMMUNEKREDIT / 2,875% / 13.10.2031	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,36	Dänemark
VERIZON COMMUNICATIONS INC / 0,193% / 24.03.2028	J. Information und Kommunikation	1,31	Vereinigte Staaten von Amerika
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA / 0,400% / 25.09.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,31	Australien
FIRST ABU DHABI BANK PJSC / 0,068% / 31.03.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,30	Vereinigte Arabische Emirate
OESTERREICH KONTROLLBANK / 2,875% / 25.02.2030	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,26	Österreich
KUNTARAHOTIUS OYJ / 1,375% / 08.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,20	Finnland
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA / 0,500% / 06.12.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,16	Mexiko
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I / 0,125% / 11.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,13	Vereinigte Staaten von Amerika
ONTARIO (PROVINZ) / 0,250% / 28.06.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,12	Kanada

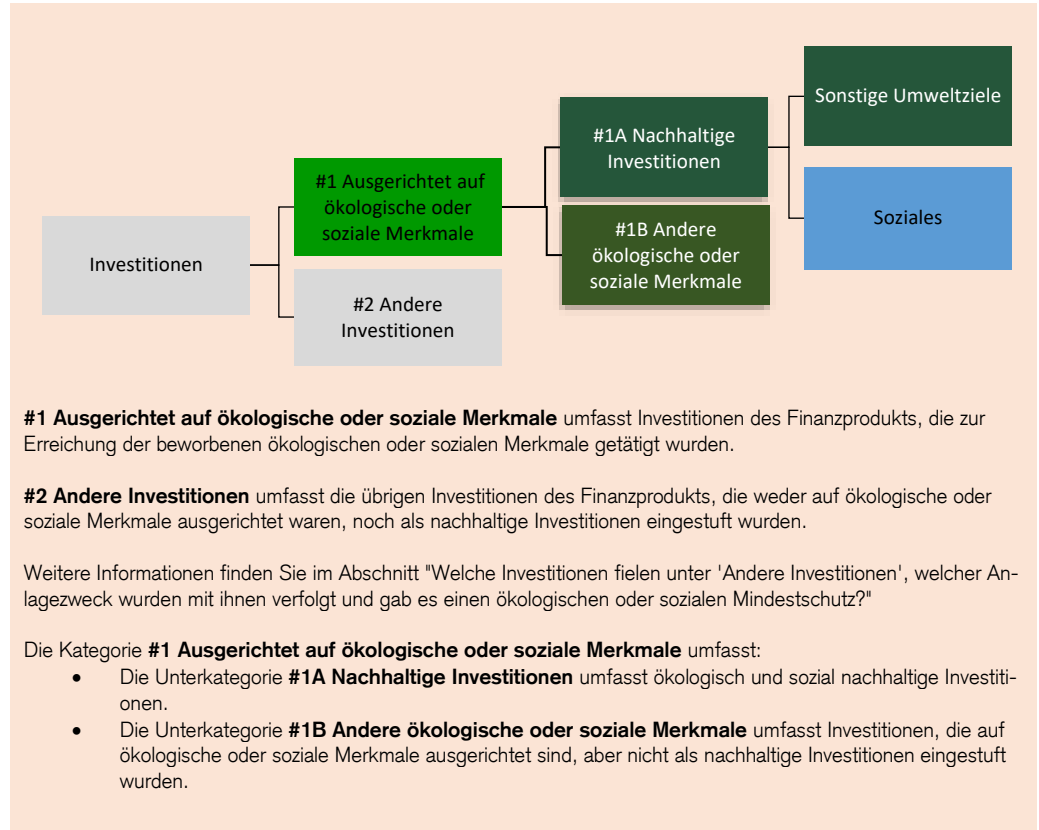
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 98,90% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 21,35 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 77,55 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 1,10 % seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	4,82%
D. Energieversorgung	1,57%
H. Verkehr und Lagerei	1,49%
I. Gastgewerbe	0,59%
J. Information und Kommunikation	2,43%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	78,12%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	1,53%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	6,86%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,69%
Andere	0,91%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar. Die Kategorie "Andere" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Subfondsenagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,00%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,00%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,00%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzeugnissen	0,00%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und den Umstieg auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31.03.2024 meldete der Subfonds ein Engagement von 0,00 % in nachhaltigen Anlagen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel.

● *Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹ ?*

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission niedergelegt.

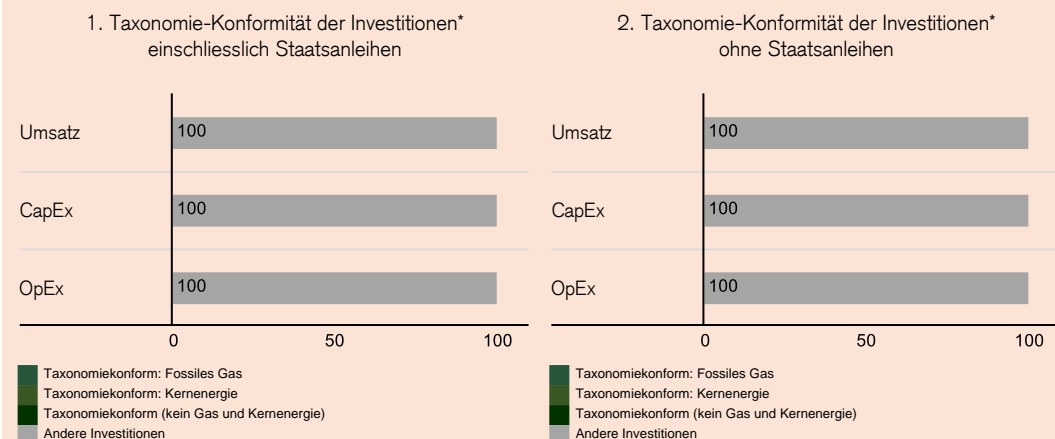
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Die berichtete EU-Taxonomie-Konformität des Subfonds war nicht Gegenstand einer Bestätigung oder einer Überprüfung durch einen Dritten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.03.2023 bei 0,00%.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Zum 31.03.2024 waren 20,83 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 0,52 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31.03.2024 waren 1,10 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

Anlagen wie z. B. Liquidität, Derivate und strukturierte Produkte können unter "Andere Investitionen" gefallen sein, da diese Instrumente nicht zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen dieses Subfonds beitragen. Weitere Informationen über das Engagement des Portfolios in diesen Anlagen sind im Abschnitt Finanzen dieses Jahresberichts aufgeführt. Diese Anlagen hatten keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Sie wurden unter Umständen als Instrumente für die effiziente Portfolioverwaltung, für die Liquiditätssteuerung, für Absicherungszwecke oder als zusätzliche Renditequelle eingesetzt.

Darüber hinaus sind Anlagen unter Umständen unter "Andere Investitionen" gefallen, wenn unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Dies galt insbesondere für Anlageklassen, für die in unzureichender Weise ESG-Faktoren festgelegt wurden oder unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Soweit möglich, wurde auf diese zugrunde liegenden Wertpapiere ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewendet, indem die Beachtung der ESG-Ausschlüsse von CSAM sichergestellt wurde.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration sowie aktives Aktionärstum an.

Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die gegen internationale Verträge über umstrittene Waffen verstießen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielten. Er schloss Unternehmen aus, die mehr als 20% ihres Umsatzes aus dem Handel mit Tabakerzeugnissen und aus Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielten. Darüber hinaus wurde eine Umsatzgrenze von 20% für Investitionen in Kohle (Kohlebergbau und Kohleverstromung) angewendet.

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

Unternehmen, bei denen systematische Verstöße gegen internationale Standards festgestellt wurden und bei denen die Verstöße besonders schwerwiegend waren oder sich die Unternehmensleitung der Umsetzung notwendiger Reformen verschloss, wurden auf eine Beobachtungsliste gesetzt und konnten aus dem gesamten Anlageuniversum von Credit Suisse ausgeschlossen werden. Dieser Prozess wurde durch einen eigens eingerichteten Ausschuss gesteuert, der die Liste der ausgeschlossenen Unternehmen führte und für die zeitnahe Übermittlung der Liste an die Anlageteams zuständig war.

ESG-Faktoren wurden in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen helfen bei der Identifizierung von nachhaltigkeitsbezogenen Themen und Chancen, die sich wahrscheinlich auf die Finanzlage oder die betriebliche Leistung von Unternehmen in einer Branche auswirken werden.

- ESG-Wertpapieranalyse

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, berechneten die Anlageverwalter eine ESG-bereinigte Kreditansicht für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds, indem sie eine eigene Methode anwendeten, um systematisch das traditionelle Kreditrating des Emittenten mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes Kreditrating abzuleiten. Das ESG-bereinigte Kreditrating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung einen Vergleich von Wertpapieren auf ESG-bereinigter Basis und eine Beurteilung dessen,

ob bestimmte Wertpapiere zum Portfolio hinzugefügt oder im Portfolio gehalten werden sollten. Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des zugrunde liegenden traditionellen Kreditratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden von den Anlageverwaltern im Bottom-up-Wertpapierauswahlprozess genutzt. Die Gewichtungen der Positionen ergaben sich aus Über- oder Untergewichtungen sowie dem Ausschluss von Wertpapieren auf Basis der ESG-bereinigten Kreditratings. In diesem Schritt kombinierten die Anlageverwalter ESG-bereinigte Kreditratings mit etablierten Instrumenten traditioneller Anlagestrategien, um fundiertere Anlageentscheidungen treffen zu können.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten täglich die ESG-Faktoren, um wesentliche Änderungen der ESG-Faktoren bei den zugrunde liegenden Wertpapieren zu erkennen, und nahmen eine regelmässige Neubeurteilung des Portfolios vor, um zu entscheiden, ob Positionen im Portfolio vergrössert oder verringert werden sollten.

- Mitwirkung

CSAM wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wurde, um seinen Einfluss auf Nachhaltigkeitsaspekte zu vergrössern. Auf ausgewählte Unternehmen, die imstande und bereit waren, Massnahmen zu ergreifen, wurde über Engagement eingewirkt, und CSAM war bestrebt, den Wert der Unternehmen, in die investiert wurde, durch Engagement zu erhalten und/oder zu steigern. Das Team für aktives Aktionärstum bestimmte die Themen und Probleme, die CSAM mit diesen Unternehmen erörtern wollte. Die daraus resultierenden Engagementaktivitäten für den Bezugszeitraum dieses SFDR-Anhangs zum Jahresbericht wurden mithilfe bestimmter Kriterien festgelegt und zielten auf Unternehmen ab, an denen die CSAM über ihre Fonds erhebliche Beteiligungen hielt. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Der Subfonds verwendete keinen Referenzwert für die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Keine Angaben.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Keine Angaben.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Keine Angaben.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Keine Angaben.



Teil des UBS-Konzerns

CREDIT SUISSE FUND MANAGEMENT S.A.
5, rue Jean Monnet
L-2180 Luxembourg
www.credit-suisse.com