

# CS Investment Funds 3

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital

luxemburgischen Rechts – R.C.S. Luxembourg B89370

**Geprüfter Jahresbericht  
zum 30.09.2023**

## Inhaltsverzeichnis

<b>Verwaltung und Organe</b>	<b>3</b>
<b>Bericht des Verwaltungsrats (ungeprüft)</b>	<b>4</b>
<b>Prüfungsvermerk</b>	<b>9</b>
<b>Kombinierter Bericht</b>	<b>15</b>
<b>Erläuterungen</b>	<b>17</b>
<b>Tätigkeitsbericht (ungeprüft)</b>	<b>21</b>
<b>Bericht per Subfonds</b>	
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund	22
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund	31
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)	38
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V	41
<b>Ungeprüfte Informationen</b>	
Vergütung	47
Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")	47
Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen	49

## Management und Verwaltung

### Die Gesellschaft

CS Investment Funds 3  
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg  
R.C.S. Luxemburg B89370

### Verwaltungsrat der Gesellschaft

Marc Berryman (seit dem 10.03.2023)  
Director, Credit Suisse Asset Management Ltd., London

Dominique Déléze (bis zum 10.03.2023)  
Director, Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Zürich

Evanthi Savoulidi (seit dem 06.11.2023)  
Director, Credit Suisse Fund Management S.A.

Petra Borisch (seit dem 06.11.2023)  
Director, Credit Suisse Fund Management S.A.

Jonathan Griffin  
Independent Director

Eduard von Kymmel  
Independent Director

### Abschlussprüfer der Gesellschaft

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

### 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.

Luc De Vet (bis zum 22.03.2023)  
Independent Director, Luxemburg

Kathrin Isch (seit dem 25.10.2022)  
Managing Director, Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Zürich

### Abschlussprüfer der Verwaltungsgesellschaft

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

### Depotbank

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

### Vertreter in der Schweiz

Credit Suisse Funds AG  
Uetlibergstrasse 231, Postfach, CH-8070 Zürich

### Zahlstelle in der Schweiz

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

### Vertriebsstellen

Credit Suisse AG  
Paradeplatz 8, CH-8001 Zürich

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

### Anlageverwalter

Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG.  
Kalandergasse 4, CH-8045 Zürich

- Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund

Co-Anlageverwalter  
Credit Suisse (Singapore) Ltd., One Raffles Link, South Lobby #03/#04-01,  
Singapur 039393

und  
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd., One Austin Road West, Kowloon, Hongkong

- Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum  
29.09.2023)
- Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V

### Zentrale Verwaltungsstelle

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

### Vertreter und Zahlstellen ausserhalb von Luxemburg und der Schweiz

Die 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 Gesellschaft veröffentlicht. Der Nettoinventarwert wird ausserdem täglich im Internet unter [www.credit-suisse.com](http://www.credit-suisse.com) sowie gegebenenfalls in verschiedenen Zeitungen veröffentlicht.

Anleger können den Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter (PRIIPS KID), die jüngsten Jahres- und Halbjahresberichte, die Aufstellung der während des Berichtszeitraums eingetretenen Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes und die Satzung kostenlos am Sitz der Gesellschaft oder von den lokalen Vertretern in den Ländern, in denen die Gesellschaft registriert ist, beziehen.

**Verwaltungsrat**

Jonathan Griffin, Non-Executive Director

Herr Griffin ist ehemaliger CEO und Vorsitzender des Verwaltungsrats von JPMorgan Asset Management (Europe) Sarl in Luxemburg. Er trat im Juni 2020 in den Ruhestand, nachdem er 34 Jahre lang Positionen bei JPMorgan im Vereinigten Königreich, in Deutschland und Tokyo innehatte, davon in den letzten 19 Jahren als CEO von JPMAME in Luxemburg. Ausserdem war er von 2005 bis 2019 Verwaltungsratsmitglied der ALFI (Luxembourg Fund Industry Association) und von 2019 bis 2020 Verwaltungsratsmitglied der EFAMA (European Fund Asset Management Association). Herr Griffin ist seit Juni 2021 Certified Independent Fund Director (CIFD).

Petra Borisch, Director (seit dem 6. November 2023)  
Credit Suisse Fund Management S.A.

Frau Borisch ist Director der Credit Suisse Fund Management S.A. mit Sitz in Luxemburg. Sie kam 2018 zur Credit Suisse Group und ist zurzeit verantwortlich für den Bereich Project Delivery and Project Management, nachdem sie verschiedene COO-Positionen im Asset Management hatte. Frau Borisch hat über 30 Jahre Berufserfahrung und hat für grosse Finanzinstitute in Deutschland und Luxemburg sowie für Unternehmensberatungsgesellschaften gearbeitet. Frau Borisch hat einen Master in Betriebswirtschaft der Universität Münster und einen Abschluss der Frankfurt School of Finance.

Evanthi Savvoulidi, Director (seit dem 6. November 2023)  
Credit Suisse Fund Management S.A.

Frau Savvoulidi ist Director der Credit Suisse Fund Management S.A. mit Sitz in Luxemburg. Frau Savvoulidi kam im Juni 2022 zu Credit Suisse Fund Management S.A. und hatte zuvor verschiedene Positionen in Rechtsabteilungen großer Finanzinstitute in Luxemburg. Sie hat einen Master in Europäischem Recht der Universität Strassburg und einen Master in öffentlichem Recht der Universität Bordeaux.

Eduard von Kymmel, Non-Executive Director

Herr von Kymmel ist ein unabhängiges nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied (INED) von mehreren Investmentfonds, einschliesslich von zahlreichen von CSM verwalteten Investmentfonds und einem AIFM. Er verfügt über 20 Jahre Berufserfahrung in der Investmentfondsbranche in Luxemburg, Liechtenstein und der Schweiz im Bereich traditioneller und alternativer Anlageklassen. Herr von Kymmel lebt als Deutsch-Luxemburger in Luxemburg, ist deutscher Volljurist (ass.iur.) und unter anderem als Chartered Director (IoD London), ILA Certified Director und EFPA ESG Advisor zertifiziert. Herr von Kymmel hat zudem einen MBA an der Universität Wales erworben. Vor seiner Tätigkeit als iNED war er von 2015 bis 2021 CEO und Vorsitzender von der VP Bank AG gesponserten ManCos, AIFM und SICAV mit Sitz in Luxemburg und Liechtenstein. Davor hatte er verschiedene leitende Funktionen bei Credit Suisse für CSIS, CS Solution Partners und CSAM in Luxemburg und Zürich inne. Bevor er zu Credit Suisse kam, war er bei Intertrust in Luxemburg tätig. Herr von Kymmel ist neben seiner Tätigkeit als iNED auch Gründer von id Linked®, einem Dienstleistungsunternehmen für Corporate Governance mit Sitz in Luxemburg.

Marc Berryman, Director (seit dem 10. März 2023)  
Credit Suisse Asset Management, UK

Herr Berryman ist Director bei Credit Suisse Asset Management mit Sitz in London. Er ist Chief Operating Officer und Verwaltungsratsmitglied der Credit Suisse Asset Management Ltd. sowie Verwaltungsratsmitglied von verschiedenen von CSAM verwalteten Investmentfonds. Herr Berryman kam im Juni 2020 zur Credit Suisse Asset Management und war zwischen 2015 und 2020 Director der CFO-Division von Credit Suisse. Zuvor war Herr Berryman für die Standard Chartered Bank tätig, wo er von 2012 bis 2015 verschiedene Positionen in der Group Finance bekleidete. Herr Berryman hat seinen Master in Maschinenbau an der Universität Cardiff absolviert und ist Fellow des Institute of Chartered Accountants in England und Wales. Herr Berryman ist auch Verwaltungsratsmitglied von ODI, einem globalen Think-Tank, und Mitglied des Strategic Business & Risk Committee der Investment Association.

### Fondsstruktur

CS Investment Funds 3 (der "Fonds") ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (société d'investissement à capital variable) in Form einer Aktiengesellschaft (société anonyme) nach dem Recht des Grossherzogtums Luxemburg. Der Fonds wurde am 11. Oktober 2002 gegründet und ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäss Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in seiner geänderten Fassung (das "Gesetz von 2010") registriert.

Der Verwaltungsrat des Fonds (der "Verwaltungsrat") hat Credit Suisse Fund Management S.A als Verwaltungsgesellschaft des Fonds (der "Manager") im Sinne von Kapitel 15 des oben genannten Gesetzes vom 17. Dezember 2010 bestellt. Der Manager untersteht der Aufsicht der Luxemburger Finanzaufsichtsbehörde Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF).

Der Fonds ist als Umbrella-Fonds mit mehreren Subfonds organisiert, die jeweils ein eigenes Anlageziel, eine eigene Anlagepolitik und eigene Anlagebeschränkungen haben.

Ziel des Fonds ist es, die ihm zur Verfügung stehenden Mittel in jede Art von übertragbaren Wertpapieren und anderen gesetzlich zulässigen Anlagen zu platzieren, um die Anlagerisiken zu streuen und die Aktionäre an den Ergebnissen der Verwaltung des Portfolios teilhaben zu lassen. Der Fonds kann jede Art von Massnahmen treffen und jede Art von Geschäften eingehen, die er für die Erfüllung und Entwicklung seines Zwecks für nützlich hält, soweit nach Teil I des Gesetzes von 2010 zulässig.

Per 30. September 2023 hatte der Fonds 3 Subfonds mit Aktienklassen, die für Angebot und Vertrieb im Grossherzogtum Luxemburg und in den folgenden Ländern registriert sind: Australien, Bahrain, Chile, Deutschland, Finnland, Frankreich, Italien, Liechtenstein, Niederlande, Norwegen, Österreich, Peru, Saudi-Arabien, Schweden, Schweiz, Singapur, Spanien, Südafrika und Vereinigtes Königreich.

### Rolle und Verantwortung des Verwaltungsrats

Die Verantwortung des Verwaltungsrats unterliegt ausschliesslich luxemburgischen Recht. In Bezug auf den Jahresabschluss des Fonds werden die Pflichten des Verwaltungsrats durch das luxemburgische Gesetz vom 10. Dezember 2010 über die Einführung internationaler Rechnungslegungsstandards für Unternehmen in seiner geänderten Fassung und das Gesetz von 2010 geregelt.

In einem Verwaltungsvertrag zwischen dem Fonds und dem Manager sind die Zuständigkeiten des Managers dargelegt.

Die Verwaltungsratsmitglieder treffen Entscheidungen im Interesse des Fonds und seiner Aktionäre in ihrer Gesamtheit und beteiligen sich nicht an Beratungen oder Entscheidungen, die zu einem Interessenkonflikt zwischen ihren persönlichen Interessen und denen des Fonds und seiner Aktionäre führen.

Der Verwaltungsrat kann bei Bedarf unabhängige fachliche Beratung auf Kosten des Fonds in Anspruch nehmen.

### Zusammensetzung des Verwaltungsrats und Vergütung

Per 30. September 2023 setzt sich der Verwaltungsrat aus einem bei Credit Suisse Asset Management UK beschäftigten Verwaltungsratsmitglied, zwei von Credit Suisse Fund Management S.A. beschäftigten Verwaltungsratsmitgliedern und zwei nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern zusammen, die keine geschäftlichen, familiären oder sonstigen Beziehungen zu dem Fonds, seinen Anlageverwaltern oder seiner Verwaltungsgesellschaft haben.

Der Verwaltungsrat berücksichtigt bei der Bestellung eines Verwaltungsratsmitglieds die relative Mischung und Zusammensetzung des Verwaltungsrats, der in seiner Gesamtheit über ein breites Spektrum an Anlagewissen, finanziellen Kompetenzen sowie rechtlichen und anderen Erfahrungen verfügt, die für die Geschäftstätigkeit des Fonds relevant sind.

Der Verwaltungsrat schränkt die Anzahl der Dienstjahre der Verwaltungsratsmitglieder nicht ein und berücksichtigt die Art und Anforderungen der Fondsbranche und der Geschäftstätigkeit des Fonds, wenn er den Aktionären Verwaltungsratsmitglieder zur Wahl vorschlägt. Die Bedingungen zur Bestellung der einzelnen Verwaltungsratsmitglieder werden in einem Dienstleistungsvertrag niedergelegt und stehen am Geschäftssitz des Fonds zur Einsicht zur Verfügung.

Die Gesamtvergütung der nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder beläuft sich auf ca. EUR 25'000 p.a., und wird anteilig berechnet, wenn die nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder nur einen Teil des Jahres im Amt waren. Die Gebühren für künftige Zeiträume können aufgrund von Inflation oder aus anderen Gründen entsprechend angepasst werden. Mitarbeitende der Credit Suisse Gruppe erhalten keine zusätzlichen Vergütungen für ihre Mandate als Verwaltungsratsmitglied.

### Sitzungen und Ausschüsse des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat kommt in der Regel quartalsweise zusammen. Soweit erforderlich, werden zusätzliche Sitzungen anberaumt.

### Verkaufsprospekt

Der Verkaufsprospekt des Fonds wurde zuletzt im April 2023 geändert.

### Jahreshauptversammlungen

Die nächste Jahreshauptversammlung des Fonds (die "Jahreshauptversammlung") findet am Dienstag, den 15. Februar 2024 am eingetragenen Sitz des Fonds statt, um Angelegenheiten in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 zu erörtern. Auf dieser Versammlung werden die Aktionäre gebeten, über die für solche Versammlungen üblichen Themen zu beschliessen, darunter (i) die Feststellung des Jahresabschlusses und die Genehmigung der Gewinnverwendung, (ii) die Entlastung und Erneuerung der Mandate der Verwaltungsratsmitglieder und (iii) die Erneuerung des Mandats des Wirtschaftsprüfers.

## Bericht des Verwaltungsrats (ungeprüft)

**Entlastung des Verwaltungsrats**

Wie nach luxemburgischem Recht vorgeschrieben, müssen die Aktionäre im Rahmen eines Beschlusses der Jahreshauptversammlung über die Entlastung des Verwaltungsrats für das betreffende Geschäftsjahr abstimmen. Diese Entlastung ist nur gültig, wenn der Jahresabschluss keine Auslassungen und falschen Angaben enthält, welche die tatsächliche Finanzlage des Fonds verschleiern.

**Ausschüttungen an die Aktionäre des Fonds**

Die folgenden Ausschüttungen erfolgten an die Aktionäre:

Name des Fonds	ISIN	Währung	Bruttoausschüttung	Ex Datum	Marktwert Datum
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund - IA25 USD	LU1570403912	USD	<b>8,74</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund - IAH CHF	LU2021636456	CHF	<b>0,78</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund - IAH25 EUR	LU1570404134	EUR	<b>7,54</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -A- USD	LU0660296467	USD	<b>0,69</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -DA- USD	LU2039695627	USD	<b>9,26</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -EA- USD	LU1024388172	USD	<b>8,01</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -IA- USD	LU1667375676	USD	<b>0,86</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund MAH EUR	LU2295692953	EUR	<b>8,26</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -UA- USD	LU1144396493	USD	<b>0,83</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -DA- USD	LU2039695973	USD	<b>8,02</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -IA- USD	LU1598841127	USD	<b>7,08</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V - IAH GBP	LU2062504290	GBP	<b>5,00</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -A- HKD	LU2062620872	HKD	<b>7,50</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -A- USD	LU2062620526	USD	<b>0,75</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- AUD	LU2062500207	AUD	<b>0,50</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- SGD	LU2062500462	SGD	<b>0,70</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -DA- USD	LU2062502088	USD	<b>7,72</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -IA- USD	LU2062503722	USD	<b>7,50</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -UA- USD	LU2062511311	USD	<b>0,75</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV - IA25 USD	LU1886381471	USD	<b>10,36</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- HKD	LU1886375820	HKD	<b>7,30</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- USD	LU1886375663	USD	<b>1,03</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- AUD	LU1886376398	AUD	<b>0,93</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- SGD	LU1886376125	SGD	<b>1,00</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -IA- USD	LU1886379061	USD	<b>10,36</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -UA- USD	LU1886386272	USD	<b>1,03</b>	02.11.2022	04.11.2022
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund - IA25 USD	LU1570403912	USD	<b>9,38</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund - IAH CHF	LU2021636456	CHF	<b>0,76</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund - IAH25 EUR	LU1570404134	EUR	<b>7,68</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -A- USD	LU0660296467	USD	<b>0,77</b>	07.02.2023	09.02.2023

Name des Fonds	ISIN	Währung	Bruttoausschüttung	Ex Datum	Marktwert Datum
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -DA- USD	LU2039695627	USD	<b>9,93</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -EA- USD	LU1024388172	USD	<b>8,65</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -IA- USD	LU1667375676	USD	<b>0,93</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -UA- USD	LU1144396493	USD	<b>0,90</b>	07.02.2023	09.02.2023
CS (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund MAH EUR	LU2295692953	EUR	<b>8,41</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -DA- USD	LU2039695973	USD	<b>8,16</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund DAH EUR	LU2546465555	EUR	<b>7,41</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -IA- USD	LU1598841127	USD	<b>7,20</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V - IAH GBP	LU2062504290	GBP	<b>5,00</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -A- USD	LU2062620526	USD	<b>0,75</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- AUD	LU2062500207	AUD	<b>0,50</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- SGD	LU2062500462	SGD	<b>0,70</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -IA- USD	LU2062503722	USD	<b>7,50</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -UA- USD	LU2062511311	USD	<b>0,75</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV - IA25 USD	LU1886381471	USD	<b>14,03</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- HKD	LU1886375820	HKD	<b>10,59</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- USD	LU1886375663	USD	<b>1,40</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- AUD	LU1886376398	AUD	<b>1,19</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- SGD	LU1886376125	SGD	<b>1,23</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -IA- USD	LU1886379061	USD	<b>14,03</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -UA- USD	LU1886386272	USD	<b>1,40</b>	07.02.2023	09.02.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -A- USD	LU0660296467	USD	<b>0,72</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -DA- USD	LU2039695627	USD	<b>9,57</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -EA- USD	LU1024388172	USD	<b>8,19</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -IA- USD	LU1667375676	USD	<b>0,89</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -IA25 USD	LU1570403912	USD	<b>8,99</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -UA- USD	LU1144396493	USD	<b>0,86</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -DA- USD	LU2039695973	USD	<b>8,27</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund DAH EUR	LU2546465555	EUR	<b>10,15</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -IA- USD	LU1598841127	USD	<b>7,26</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -A- USD	LU2062620526	USD	<b>0,75</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- AUD	LU2062500207	AUD	<b>0,50</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- SGD	LU2062500462	SGD	<b>0,70</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -IA- USD	LU2062503722	USD	<b>7,50</b>	02.05.2023	04.05.2023

## Bericht des Verwaltungsrats (ungeprüft)

Name des Fonds	ISIN	Währung	Bruttoausschüttung	Ex Datum	Marktwert Datum
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -IAH GBP	LU2062504290	GBP	<b>5,00</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -UA- USD	LU2062511311	USD	<b>0,75</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- HKD	LU1886375820	HKD	<b>9,06</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- USD	LU1886375663	USD	<b>1,59</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- AUD	LU1886376398	AUD	<b>1,31</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- SGD	LU1886376125	SGD	<b>1,37</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -IA- USD	LU1886379061	USD	<b>15,99</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -IA25 USD	LU1886381471	USD	<b>15,99</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -UA- USD	LU1886386272	USD	<b>1,59</b>	02.05.2023	04.05.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -A- USD	LU0660296467	USD	<b>0,74</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -DA- USD	LU2039695627	USD	<b>9,81</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -EA- USD	LU1024388172	USD	<b>8,47</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -IA- USD	LU1667375676	USD	<b>0,92</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -UA- USD	LU1144396493	USD	<b>0,88</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -DA- USD	LU2039695973	USD	<b>8,23</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund DAH EUR	LU2546465555	EUR	<b>10,18</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -IA- USD	LU1598841127	USD	<b>7,23</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V - IAH GBP	LU2062504290	GBP	<b>5,00</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -A- USD	LU2062620526	USD	<b>0,75</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- AUD	LU2062500207	AUD	<b>0,50</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -AH- SGD	LU2062500462	SGD	<b>0,70</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -IA- USD	LU2062503722	USD	<b>7,50</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -UA- USD	LU2062511311	USD	<b>0,75</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV - IA25 USD	LU1886381471	USD	<b>17,41</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- HKD	LU1886375820	HKD	<b>13,53</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -A- USD	LU1886375663	USD	<b>1,74</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- AUD	LU1886376398	AUD	<b>1,45</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -AH- SGD	LU1886376125	SGD	<b>1,40</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -IA- USD	LU1886379061	USD	<b>17,41</b>	01.08.2023	03.08.2023
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV -UA- USD	LU1886386272	USD	<b>1,74</b>	01.08.2023	03.08.2023





## **Audit report**

To the Shareholders of  
**CS Investment Funds 3**

---

### **Our opinion**

In our opinion, the accompanying financial statements give a true and fair view of the financial position of CS Investment Funds 3 (the "Fund") and of each of its sub-funds as at 30 September 2023, 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 30 September 2023;
  - 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 30 September 2023; 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 Fund 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.



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 Fund for the financial statements**

The Board of Directors of the Fund 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 Fund 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 Fund 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 Fund 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 Fund;



- conclude on the appropriateness of the Board of Directors of the Fund'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 (except for Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV where a decision to liquidate exists) 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

Luxembourg, 22 January 2024

Represented by

Pierre-Marie Bochereau

The English version of the Annual Report has been reviewed by the auditor. Consequently, the audit report only refers to the English version of the report; other versions result from a translation made under the responsibility of the Board of Directors of the Fund.



An die Aktionäre der  
**CS Investment Funds 3**

---

### **Unser Prüfungsurteil**

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der CS Investment Funds 3 und ihres Teilfonds („der Fonds“) und seiner jeweiligen Teilfonds zum 30. September 2023 sowie der Ertragslage und der Veränderung des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

*Was wir geprüft haben*

Der Abschluss des Fonds besteht aus:

- der kombinierten Nettovermögensaufstellung des Fonds und der Nettovermögensaufstellung des Teilfonds zum 30. September 2023;
- der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens des Fonds und der Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens des Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr;
- der Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte des Teilfonds zum 30. September 2023; und
- einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden und anderen erläuternden Informationen.

---

### **Grundlage für das Prüfungsurteil**

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISAs) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs wird im Abschnitt „Verantwortung des „Réviseur d'entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung“ weitergehend beschrieben.

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

Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen „International Ethics Standards Board for Accountants' Code of Ethics for Professional Accountants“ (IESBA Code) sowie den beruflichen Verhaltensanforderungen, die wir im Rahmen der Abschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt.



### **Sonstige Informationen**

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, die im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Abschluss oder unseren Prüfungsvermerk zu diesem Abschluss.

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

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Abschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Abschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

---

### **Verantwortung des Verwaltungsrates des Fonds für den Abschluss**

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung des Abschlusses und für die internen Kontrollen, die er als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Abschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben ist, unabhängig davon, ob diese aus Unrichtigkeiten oder Verstößen resultieren.

Bei der Aufstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds und ihres Teilfonds zur Fortführung der Tätigkeit und, sofern einschlägig, Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Tätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Verwaltungsrat des Fonds beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren oder ihren Teilfonds zu schließen, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

---

### **Verantwortung des „Réviseur d'entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung**

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben, entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen ist, und darüber einen Prüfungsvermerk, der unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. 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 unzutreffende Angabe, falls vorhanden, aufdeckt. Unzutreffende Angaben 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 Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen könnten.



Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen unzutreffenden Angaben im Abschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Angaben nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können;
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der durch den Verwaltungsrat des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangsangaben;
- schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Tätigkeit durch den Verwaltungsrat des Fonds sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder ihres Teilfonds zur Fortführung der Tätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Prüfungsvermerk auf die dazugehörigen Anhangsangaben zum Abschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Prüfungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder ihr Teilfonds seine Tätigkeit nicht mehr fortführen kann (mit Ausnahme des Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV, bei dem ein Liquidationsbeschluss vorliegt) die Fortführung des Unternehmens einzustellen;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Anhangsangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, 22 Januar 2024

Pierre-Marie Bochereau

**Nettovermögensaufstellung (in CHF)****30.09.2023****Aktiva**

Wertpapierbestand zum Marktwert	1.223.156.773,55
Bankguthaben und sonstige	10.337.149,72
Forderungen aus Verkauf von Wertpapieren	11.435.064,94
Forderungen aus Erträgen	15.081.439,96
Zinsforderungen	516.626,88
Andere Aktiva	4.069,49
	<b>1.260.531.124,54</b>

**Passiva**

Bankverbindlichkeiten und sonstige	11.791.664,80
Rückstellungen für Aufwendungen	624.436,16
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Finanzterminkontrakten	1.021.294,30
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten	113.203,01
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	5.136.036,63
Andere Passiva	230.065,58
	<b>18.916.700,48</b>

<b>Nettovermögen</b>	<b>1.241.614.424,06</b>
----------------------	-------------------------

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens (in CHF)**Für die Periode vom  
01.10.2022 bis zum  
30.09.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>2.623.114.217,31</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	90.084.588,33
Bankzinsen	1.095.437,29
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	1.408.578,54
	<b>92.588.604,16</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	8.880.601,33
Depotbank- und Depotgebühr	1.202.590,97
Verwaltungskosten	1.086.801,58
Druck- und Veröffentlichungskosten	174.918,91
Zinsen und Bankspesen	14.524,42
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	1.043.437,41
"Taxe d'abonnement"	523.981,09
	<b>12.926.855,71</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>79.661.748,45</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-335.757.903,85
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-2.089.907,56
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	5.928.201,25
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	28.056.936,30
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-11.748.878,23
	<b>-315.611.552,01</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-235.949.803,56</b>
<b>Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	384.711.507,27
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	-158.518,65
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-5.443.500,12
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	5.132.977,09
	<b>384.242.465,59</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>148.292.662,03</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	201.650.088,33
Rücknahmen	-1.505.227.598,97
	<b>-1.303.577.510,64</b>
<b>Ausschüttung</b>	<b>-41.190.199,18</b>
<b>Währungsdifferenz</b>	<b>-185.024.745,38</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>1.241.614.424,06</b>



## Allgemeines

CS Investment Funds 3 (die "Gesellschaft") ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (SICAV) nach luxemburgischen Recht. Die Gesellschaft hat eine Umbrella-Struktur und wurde am 11.10.2002 als Organismus für gemeinsame Anlagen gemäss den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes vom 17.12.2010 in seiner geänderten Fassung in Luxemburg gegründet.

Die Gesellschaft hat eine Umbrella-Struktur und hat daher mindestens einen Subfonds.

Zum 30.09.2023 hatte die Gesellschaft 3 Subfonds aufgelegt.

Änderungen:

Die Laufzeit des Subfonds Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV endete am 29.09.2023.

## Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

### a) Darstellung des Abschlusses

Die Abschlüsse wurden gemäß den in Luxemburg für Investmentfonds geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unter der Annahme der Fortführung der Geschäftstätigkeit (going concern) erstellt, mit Ausnahme des Subfonds Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV, dessen Laufzeit am 29.09.2023 endete.

### b) Berechnung des Nettoinventarwerts des jeweiligen Subfonds

Der Nettoinventarwert der Anteile jedes Subfonds wird in der Referenzwährung des jeweiligen Subfonds berechnet und wird unter der Verantwortung des Verwaltungsrats der Gesellschaft in Luxemburg an jedem Bankarbeitstag in Luxemburg (jeweils ein "Bewertungstag") ermittelt. Ein Bankarbeitstag ist definiert als ein Tag, an dem Banken in Luxemburg normalerweise für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Die Abschlüsse berücksichtigen die Nettoinventarwerte, die auf den Marktpreisen der Anlagen vom 29.09.2023 basieren.

Der Anlageverwalter muss Transaktionen ausführen, um die gewünschte Vermögensallokation nach Zeichnungen oder Rücknahmen aufrechtzuerhalten. Hierdurch können zusätzliche Kosten für den Subfonds und die Anteilinhaber entstehen. Um die Interessen der vorhandenen Anteilinhaber vor solchen Kapitalschwankungen zu schützen, wird daher eine Anpassung des verwendeten NIW pro Anteil vorgenommen, wenn die Netto-Kapitalschwankungen einen vom Verwaltungsrat festgelegten Grenzwert überschreiten. Diese Anpassung spiegelt die geschätzten Steuer- und Handelskosten wider, die dem Fonds durch diese Transaktionen entstehen können, sowie den geschätzten Spread-Effekt der Vermögenswerte, in denen der Fonds anlegt. Es werden regelmässige Überprüfungen durchgeführt, um festzustellen, 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 Gesamtnettovermögen (Total Net Assets, "TNA"), das in der Aufstellung des Nettovermögens aufgeführt ist, das Gesamtnettovermögen ohne Swing-Anpassung zum Jahresende 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.

In dem am 30.09.2023 abgeschlossenen Jahr wendeten die Subfonds Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund, Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund, Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023-S-IV und Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024-S-V Swing-Pricing an.

Zum 30.09.2023 wurde kein Swing-Pricing angewendet.

### c) Bewertung des Wertpapierbestands des jeweiligen Subfonds

Wertpapiere, die an einer Wertpapierbörse kotiert sind oder regelmässig gehandelt werden, werden zum zuletzt verfügbaren Handelspreis bewertet. Ist ein solcher Preis an einem bestimmten Handelstag nicht verfügbar, kann der mittlere Marktschlusskurs (der Mittelwert der letzten Brief- und Geldkurse) oder alternativ der Schlussgeldkurs als Bewertungsgrundlage herangezogen werden.

Wird ein Wertpapier an mehreren Börsen gehandelt, so ist von der Börse, an welcher es vornehmlich gehandelt wird, auszugehen.

Wenn ein Wertpapier von Wertpapierhändlern regelmässig an einem Sekundärmarkt gehandelt wird (sodass der Handelskurs die Marktbedingungen abbildet), kann dieser Sekundärmarkt als Bewertungsgrundlage dienen.

Wertpapiere, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden nach der gleichen Methode bewertet wie diejenigen, die an einer Börse notiert sind.

Wertpapiere, welche nicht an einer Börse notiert sind oder nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zu ihrem letzten erhältlichen Marktpreis bewertet. Ist ein solcher nicht verfügbar, erfolgt die Bewertung der Wertpapiere durch die Gesellschaft gemäss anderen vom Verwaltungsrat festzulegenden Kriterien und auf der Grundlage des voraussichtlich möglichen Verkaufspreises, dessen Wert mit der gebührenden Sorgfalt und nach bestem Wissen veranschlagt wird.

Derivate werden gemäss den vorhergehenden Abschnitten behandelt. OTC-Swap-Geschäfte werden auf konsistente Weise auf der Grundlage von Geld-, Brief- oder mittleren Kursen bewertet, die nach den vom Verwaltungsrat festgelegten Verfahren nach Treu und Glauben bestimmt werden. Bei der Entscheidung, ob Geld-, Brief- oder mittlere Kurse verwendet werden, berücksichtigt der Verwaltungsrat neben anderen Parametern die erwarteten Zeichnungs- und Rücknahmeflüsse. Wenn diese Werte nach Auffassung des Verwaltungsrats nicht dem Marktwert der betreffenden OTC-Swap-Geschäfte entsprechen, wird deren Wert vom Verwaltungsrat nach Treu und Glauben oder nach einer anderen Methode, die der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen für geeignet hält, festgelegt.

Der Bewertungspreis eines Geldmarktinstruments, dessen Laufzeit oder Restlaufzeit weniger als zwölf Monate beträgt und das keine spezifische Sensitivität zu Marktparametern, einschliesslich Kreditrisiko, aufweist, wird basierend auf dem Nettoerwerbspreis oder dem Preis zu dem Zeitpunkt, an dem die Restlaufzeit der Anlage unter zwölf Monate fällt, schrittweise an den Rückzahlungspreis angepasst, während die sich ergebende Anlagerendite konstant gehalten wird. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen muss die Grundlage für die Bewertung verschiedener Anlagen an den neuen Marktrenditen ausgerichtet werden.

Anteile oder Aktien an OGAW oder sonstigen OGA werden grundsätzlich nach ihrem letzten errechneten Nettoinventarwert bewertet, gegebenenfalls unter Berücksichtigung der Rücknahmegebühr. Wenn für Anteile oder Aktien solcher OGAW oder anderer OGA kein Nettoinventarwert, sondern nur Kauf- und Verkaufspreise vorliegen, können die Anteile oder Aktien dieser OGAW oder anderen OGA zum Mittelwert dieser Kauf- und Verkaufspreise bewertet werden.

Treuhand- oder Festgeldanlagen werden zu ihrem jeweiligen Nominalwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen bewertet.

### d) Guthaben bei Banken und Maklern

Guthaben bei Banken und Maklern umfassen Barbestände, Nachschussforderungen und Sichteinlagen bei Banken sowie sonstige kurzfristige Anlagen an einem aktiven Markt mit einer ursprünglichen Laufzeit von bis zu drei Monaten 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.

Bankguthaben und sonstige Nettovermögenswerte 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 als die Referenzwährung jedes Subfonds lauten, werden zu dem Wechselkurs, der an dem Tag gilt, an dem sie dem Subfonds entstehen, in die Referenzwährung umgerechnet.

Währungsgewinne oder -verluste werden im Abschluss unter "Ertrags- und Aufwandsrechnung" berücksichtigt.

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) 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.

## k) Bewertung von Swaps

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

Bei der Bewertung von Excess Return Swaps wird der jeweilige Basiswert berücksichtigt. Die daraus resultierenden nicht realisierten Gewinne und Verluste werden unter dem nicht realisierten Gewinn/Verlust aus Swap-Kontrakten in der Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden auch in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung/Veränderung des Nettovermögens" unter "Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swap-Kontrakten" verbucht.

## l) Wertpapierleihgeschäfte

Die Gesellschaft kann mit Wertpapieren in den Portfolios ihrer Subfonds Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Die Gesellschaft 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. Der Ertrag aus der Wertpapierleihe weist den Bruttoertrag aus der Wertpapierleihe abzüglich der direkten und indirekten Kosten aus, die von der Gegenpartei, die als Wertpapierleihe-Principal fungiert, erhoben werden.

## m) Buchung von Erträgen

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

## n) Sonstige Erträge

Während des Jahres vereinnahmte Bestandsprovisionen werden unter "Sonstige Erträge" verbucht.

**Depotbankgebühr**

Die Depotbank erhält von der Gesellschaft 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.

**Verwaltungsstellengebühr**

Die Verwaltungs-, Register- und Transferstelle erhält von der Gesellschaft 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.

**Verwaltungsgebühr**

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Zur Vergütung ihrer Dienstleistungen und Erstattung ihrer Kosten hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine monatliche Verwaltungsgebühr, die jeweils am Monatsende zahlbar ist. Berechnungsgrundlage der Gebühr ist der durchschnittliche tägliche Nettoinventarwert der jeweiligen Anteilsklasse in dem entsprechenden Monat.

Für die Anteilsklassen DA, DAH, DB und DBH wird keine Verwaltungsgebühr erhoben, sondern lediglich eine Gebühr für Verwaltungsdienstleistungen, die an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen ist und alle Gebühren und Aufwendungen abdeckt und höchstens 0,35% p.a. beträgt. Zusätzliche Gebühren werden zu den Bedingungen einer separaten, mit dem betreffenden Unternehmen von Credit Suisse Group AG abgeschlossenen Vereinbarung direkt vom Anleger erhoben.

**"Taxe d'abonnement"**

Nach den geltenden Gesetzen und Vorschriften unterliegt die Gesellschaft in Luxemburg auf Basis ihrer 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 Aktienklassen, 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.

**Transaktionskosten**

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

In dem am 30.09.2023 abgeschlossenen Jahr entstanden der Gesellschaft 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) Emerging Market Corporate Bond Fund	USD	786,60
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund	USD	4.517,25
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)	USD	-
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V	USD	-

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.

**Barsicherheiten**

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

Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund:

Währung	Marktwert der Sicherheiten	Gegenpartei
USD	180.000,00	J.P. Morgan Chicago

## Erläuterungen

**Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER)**  
(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die Total Expense Ratio (TER) wird auf Basis der aktuell gültigen Fassung der "Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen" der Asset Management Association Switzerland (AMAS) berechnet. Die TER wird für den Zeitraum vom 01.10.2022 bis zum 30.09.2023 berechnet.

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

Für Anteilsklassen, die weniger als 6 Monate vor Abschluss aufgelegt wurden, wird keine TER ausgewiesen.

**Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands**

Der Bericht über alle während des Berichtsjahres eingetretenen Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes kann von den Anlegern am Sitz der Gesellschaft oder der lokalen Vertreter in den Ländern, in welchen die Gesellschaft registriert ist, kostenlos bezogen werden.

**Wechselkurse**

Der konsolidierte Abschluss wird in CHF erstellt. Zu diesem Zweck werden die Abschlüsse der einzelnen Subfonds zu dem am 30.09.2023 geltenden Wechselkurs in CHF umgerechnet:

- USD 1 = CHF 0,914805

**Fondsperformance**

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die Performance basiert auf den am letzten Geschäftstag des Kalenderjahres J bzw. J-1 berechneten Nettoinventarwerten. Diese Nettoinventarwerte spiegeln die Marktpreise der Anlagen am letzten Geschäftstag des Jahres wider.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf gegenwärtige oder künftige Wertentwicklungen. Bei den Performanceangaben sind bei der Zeichnung und Rücknahme von Aktien der Fonds erhobene Kosten und Provisionen nicht berücksichtigt. Die Performance seit Jahresbeginn (YTD) bezieht sich auf den Zeitraum vom 01.01.2023 bis zum 30.09.2023.

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

Die Performance von ausschüttenden Anteilen versteht sich mit Wiederanlage der Dividenden.

**Wertpapierleihe**

Per 30.09.2023 partizipierten die Subfonds am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG wie folgt:

Subfonds	Währung	Marktwert der Wertpapierleihe	Marktwert der Sicherheiten
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund	USD	72.572.566,00	76.519.398,79
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund	USD	-	-
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)	USD	-	-
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V	USD	-	-

Die von der Gegenpartei des Wertpapierleihgeschäfts für die Gesellschaft 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 Börsen innerhalb der OECD kotiert sind, unter der Voraussetzung, dass diese Aktien 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 vom Principal aus seinen Gebühren getragen und umfassen das vom Principal getragene Haftungsrisiko.

Für das Jahr bis zum 30.09.2023 belief sich die an den Principal gezahlte Gebühr auf folgende Beträge:

Subfonds	Währung	Bruttobetrag Erträge aus Wertpapierleihe	Aufwendungen und Provisionen von der Gegenpartei der Wertpapierleihgeschäfte	Nettobetrag
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund	USD	739.294,18	195.601,46	543.692,72
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund	USD	-	-	-
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)	USD	835.994,40	242.691,41	593.302,99
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V	USD	543.806,79	141.044,58	402.762,21

**Derivative Finanzinstrumente**

Der Subfonds kann Derivategeschäfte zum Zweck der effizienten Portfolioverwaltung tätigen. Details der Derivate sind in den Erläuterungen aufgeführt.

Je nach Art der gehaltenen Derivate können Sicherheiten von verschiedenen Gegenparteien entgegengenommen werden, um das Gegenparteiisiko zu mindern. Für andere Arten von Derivaten können Margenkonten genutzt werden. Per 30.09.2023 hatte die Gesellschaft keine Sicherheiten angenommen, um das Gegenparteiisiko zu mindern.

**Risikomanagement**

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

**Bedeutendes Ereignis während des Berichtsjahres**

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.

Da russische Wertpapiere gegenwärtig keinen Marktzugang haben, wurde die Bewertung aller auf Rubel lautenden russischen Wertpapiere (einschliesslich ADRs/GDRs) auf einen Preis von null gesetzt. Bei den übrigen nicht auf Rubel lautenden russischen Wertpapieren wird weiterhin der erwartete realisierbare Liquidationswert als Preis angesetzt.

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.

#### **Transparenz bei der Bewertung 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 Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale und nachhaltiger Investitionen zu finden.

#### **Ereignisse nach dem Bilanzstichtag**

---

Nach dem Ende des Berichtsjahres sind keine bedeutenden Ereignisse eingetreten.

## Bericht des Managers (ungeprüft)

### Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund

Der Berichtszeitraum war von einem anhaltenden Straffungszyklus der weltweiten Zentralbanken zur Eindämmung der Inflation geprägt. Während des Berichtszeitraums hob die US-Notenbank Fed ihren Leitzins um 225 Basispunkte in eine Zielbandbreite von 5,25% bis 5,5% an. Die restriktiveren geldpolitischen Bedingungen weltweit führten dazu, dass die Inflationsraten in vielen Volkswirtschaften ihren Spitzenwert erreichten. Die anhaltenden Zinsanhebungen übten aufgrund der Aufwärtsverschiebung in der Renditekurve von US-Staatsanleihen Druck auf den Anleihenmarkt aus. In diesem Umfeld hielten sich Unternehmensanleihen der Schwellenländer gut, da sich die Kreditspreads über den Berichtszeitraum verengten. Insbesondere Hochzinsanleihen verzeichneten eine starke Spreadverengung und schnitten deutlich besser ab als Investment-Grade-Papiere.

Trotz des Anstiegs der US-Treasury-Renditen verzeichnete der Fonds eine positive Rendite über den Berichtszeitraum, was von engeren Kreditspreads und der starken Performance von Titeln mit High-Yield-Rating getragen wurde. Relativ betrachtet schnitt der Fonds vor Gebühren etwas besser ab als sein Vergleichsindex. Die modifizierte Duration des Fonds blieb über den Berichtszeitraum mit 3,99 gegenüber 4,06 zu Beginn des Zeitraums weitgehend unverändert. Sein durchschnittliches Rating lag weiterhin unverändert bei BB+. Der Fonds erhöhte über den Berichtszeitraum seine Gesamtallokation im Investment-Grade-Segment, während er in High-Yield-Titeln weiterhin übergewichtet blieb. Aus regionaler Sicht bestanden die wichtigsten Änderungen in einer Erhöhung der Allokation in Asien, während das Engagement im Nahen Osten reduziert wurde. Der Fonds erhöhte auch sein Engagement in Afrika ein wenig und verringerte seine Allokation in Europa und Lateinamerika. Zum Ende des Berichtszeitraums war der Fonds weiterhin gut in verschiedenen Emittenten aus Schwellenländern diversifiziert.

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

### Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund

Der Berichtszeitraum war von einem anhaltenden Straffungszyklus der weltweiten Zentralbanken zur Eindämmung der Inflation geprägt. Während des Berichtszeitraums hob die US-Notenbank Fed ihren Leitzins um 225 Basispunkte in eine Zielbandbreite von 5,25% bis 5,5% an. Die restriktiveren geldpolitischen Bedingungen weltweit führten dazu, dass die Inflationsraten in vielen Volkswirtschaften ihren Spitzenwert erreichten. Die anhaltenden Zinsanhebungen übten aufgrund der Aufwärtsverschiebung in der Renditekurve von US-Staatsanleihen Druck auf den Anleihenmarkt aus. In diesem Umfeld hielten sich Unternehmensanleihen der Schwellenländer mit Investment-Grade-Rating relativ gut, da sich die Kreditspreads über den Berichtszeitraum verengten, um einen Teil des Anstiegs der Renditekurve von US-Treasuries auszugleichen.

Trotz des Aufwärtstrends der Renditen verzeichnete der Fonds ein positives Ergebnis über den Berichtszeitraum, was von Zins-Carry und engeren Kreditspreads getragen wurde. Relativ betrachtet schnitt der Fonds vor Abzug von Gebühren besser ab als seine Benchmark. Über den Berichtszeitraum reduzierte der Fonds seine Duration ein wenig von 4,78 auf 4,55, während sein durchschnittliches Rating weiter unverändert bei BBB+ lag. Wir haben das Engagement in den am schwächsten bewerteten Investment-Grade-Titeln etwas verringert und die Allokation in höherwertigen Titeln mit den Ratings BBB und A erhöht. Wir bleiben in Titeln mit AA-Rating untergewichtet. Aus regionaler Sicht bestanden die wichtigsten Änderungen in einer Erhöhung des Engagements in Asien, während die Allokation in Barmitteln und in Lateinamerika reduziert wurde, wobei diese Position allerdings immer noch gegenüber der Benchmark übergewichtet ist. Wir haben auch unser Engagement in Emittenten aus dem Nahen Osten und Afrika erhöht. Zum Ende des Berichtszeitraums war der Fonds weiterhin gut in verschiedenen Emittenten aus Schwellenländern diversifiziert.

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

### Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft beschloss, den Subfonds zum Fälligkeitsdatum 29.09.2023 gemäss den Bestimmungen des Verkaufsprospekts einzustellen.

### Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V

Der asiatische Kreditmarkt wurde im Berichtszeitraum durch die Zinserhöhungen in den USA und die massiven Zahlungsausfälle im chinesischen Immobiliensektor beeinträchtigt. Allerdings verengte sich der Kreditspread über den Berichtszeitraum, obwohl der Markt von den zunehmenden geopolitischen Spannungen auf der Welt und in der Region, von den wachsenden globalen Rezessionsrisiken sowie von den massiven Kreditausfällen in einer Reihe von Schwellenländern beeinträchtigt wurde. Am Markt herrschte ein gewisses Mass an Risikoabneigung, sodass asiatische Hochzinsanleihen schlechter abschnitten als asiatische Investment-Grade-Anleihen, obwohl Letztere aufgrund ihrer längeren Duration stärker unter den steigenden Zinsen litten. Doch die Ausfallquoten in Asien blieben unmittelbar nach ihrem historischen Höchststand im Vorjahr auf hohen Niveaus, wobei mehr Hochzinsanleihen weiter bis auf notleidende Niveaus fielen. Der Subfonds verzeichnete über den Berichtszeitraum eine positive Rendite, wobei der Beitrag von Carry-Erträgen die Auswirkungen steigender Zinsen mehr als ausglich. Der verbleibende Anteil war im Wesentlichen einer positiven Spreadrendite aufgrund engerer Kreditspreads der Anleihenbestände zuzuschreiben. Über den Berichtszeitraum blieb die durchschnittliche Bonität des Fonds in der Bandbreite von BBB bis BBB+, während seine Duration natürlich zurückging, da der Fonds ein festes Laufzeitende hat. Unter regionalen Gesichtspunkten verringerte der Fonds sein Engagement in China, erhöhte aber seine Allokation in anderen asiatischen Ländern, sodass das Gesamtengagement in Asien stieg. Des Weiteren wurde die Gewichtung des Fonds in Nordamerika erhöht, während die im Nahen Osten, Afrika und Europa verringert wurde. Der Fonds hält diversifizierte kurzfristige Positionen und erreicht am 30.09.2024 sein Laufzeitende.

## Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund

## Technische Daten und Erläuterungen

## Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	13506687	LU0660296467	1,20%	1,44%
B - Thesaurierend	USD	13506689	LU0660296541	1,20%	1,44%
DA - Ausschüttend	USD	49881703	LU2039695627	0,00%	0,12%
DB - Thesaurierend	USD	23853646	LU1041503811	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	USD	23528508	LU1024388172	0,60%	0,79%
EB - Thesaurierend	USD	21701546	LU0947481940	0,60%	0,81%
IA - Ausschüttend	USD	37919312	LU1667375676	0,60%	0,84%
IA25 - Ausschüttend	USD	35781791	LU1570403912	0,30%	/
IB - Thesaurierend	USD	13506700	LU0660296624	0,60%	0,85%
MB - Thesaurierend	USD	19019025	LU0804456878	0,30%	0,50%
UA - Ausschüttend	USD	26311662	LU1144396493	0,70%	0,95%
UB - Thesaurierend	USD	26311925	LU1144396659	0,70%	0,94%
BH - Thesaurierend	CHF	13506692	LU0660295907	1,20%	1,52%
DBH - Thesaurierend	CHF	23853648	LU1041504546	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	CHF	24888470	LU1086899272	0,60%	0,89%
IAH - Ausschüttend	CHF	48678154	LU2021636456	0,60%	/
IBH - Thesaurierend	CHF	13506702	LU0660296202	0,60%	0,92%
UBH - Thesaurierend	CHF	26311963	LU1144396816	0,70%	1,02%
BH - Thesaurierend	EUR	13506698	LU0660296111	1,20%	1,52%
DBH - Thesaurierend	EUR	23853649	LU1041505352	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	EUR	24514532	LU1071421777	0,60%	0,89%
IAH25 - Ausschüttend	EUR	35782873	LU1570404134	0,30%	/
IBH - Thesaurierend	EUR	13506709	LU0660296384	0,60%	0,92%
MAH - Ausschüttend	EUR	59765718	LU2295692953	0,30%	/
UBH - Thesaurierend	EUR	26311981	LU1144396907	0,70%	1,02%
DBH - Thesaurierend	GBP	55610351	LU2196418938	0,00%	/

Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -MAH- EUR wurde am 17.02.2023 geschlossen.

Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -IAH25- EUR und -IAH- CHF wurde am 23.02.2023 geschlossen.

Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -IA25- USD wurde am 12.05.2023 geschlossen.

Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund -DBH- GBP wurde am 25.05.2023 geschlossen.

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die DA-Aktienklasse, DB-Aktienklasse und DBH-Aktienklasse.

## Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	1,91%	/	-22,43%	-4,41%	8,91%
B - Thesaurierend	USD	1,92%	/	-22,44%	-4,41%	8,96%
DA - Ausschüttend	USD	2,93%	/	-21,43%	-3,19%	10,36%
DB - Thesaurierend	USD	2,93%	/	-21,43%	-3,19%	10,36%
EA - Ausschüttend	USD	2,39%	/	-21,94%	-3,80%	9,69%
EB - Thesaurierend	USD	2,40%	/	-21,94%	-3,80%	9,66%
IA - Ausschüttend	USD	2,36%	/	-21,97%	-3,84%	9,62%
IA25 - Ausschüttend	USD	/	/	-21,72%	-3,55%	9,94%
IB - Thesaurierend	USD	2,38%	/	-21,97%	-3,84%	9,62%
MB - Thesaurierend	USD	2,63%	/	-21,71%	-3,51%	9,99%
UA - Ausschüttend	USD	2,30%	/	-22,05%	-3,94%	9,50%
UB - Thesaurierend	USD	2,29%	/	-22,04%	-3,93%	9,50%
BH - Thesaurierend	CHF	-1,23%	/	-24,59%	-5,43%	6,74%
DBH - Thesaurierend	CHF	-0,20%	-26,57%	-23,58%	/	/
EBH - Thesaurierend	CHF	-0,75%	-28,16%	-24,11%	/	/
IAH - Ausschüttend	CHF	/	/	-24,22%	-4,80%	7,43%
IBH - Thesaurierend	CHF	-0,78%	/	-24,14%	-4,85%	7,38%
UBH - Thesaurierend	CHF	-0,86%	/	-24,21%	-4,95%	7,28%
BH - Thesaurierend	EUR	0,10%	/	-24,37%	-5,27%	6,99%
DBH - Thesaurierend	EUR	1,13%	-25,98%	-23,37%	/	/
EBH - Thesaurierend	EUR	0,57%	/	-23,87%	-4,67%	7,66%
IAH25 - Ausschüttend	EUR	/	/	-23,78%	/	/
IBH - Thesaurierend	EUR	0,54%	/	-23,91%	-4,71%	7,66%
MAH - Ausschüttend	EUR	/	/	-23,75%	/	/
UBH - Thesaurierend	EUR	0,47%	/	-23,98%	-4,81%	7,53%
DBH - Thesaurierend	GBP	/	/	-22,22%	-3,36%	/

**Technische Daten und Erläuterungen (Fortsetzung)****Ausschüttungen**

		<b>Ex-Datum</b>	<b>Betrag</b>
A - Ausschüttend	USD	02.11.2022	0,69
A - Ausschüttend	USD	07.02.2023	0,77
A - Ausschüttend	USD	02.05.2023	0,72
A - Ausschüttend	USD	01.08.2023	0,74
DA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	9,26
DA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	9,93
DA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	9,57
DA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	9,81
EA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	8,01
EA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	8,65
EA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	8,19
EA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	8,47
IA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	0,86
IA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	0,93
IA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	0,89
IA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	0,92
IA25 - Ausschüttend	USD	07.02.2023	9,38
IA25 - Ausschüttend	USD	02.05.2023	8,99
IA25 - Ausschüttend	USD	02.11.2022	8,74
UA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	0,83
UA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	0,90
UA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	0,86
UA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	0,88
IAH - Ausschüttend	CHF	07.02.2023	0,76
IAH - Ausschüttend	CHF	02.11.2022	0,78
IAH25 - Ausschüttend	EUR	07.02.2023	7,68
IAH25 - Ausschüttend	EUR	02.11.2022	7,54
MAH - Ausschüttend	EUR	07.02.2023	8,41
MAH - Ausschüttend	EUR	02.11.2022	8,26

**Erläuterungen****Devisentermingeschäfte**

<b>Käufe</b>		<b>Verkäufe</b>		<b>Fälligkeit</b>	<b>Bewertung</b>
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	16.640	EUR	-15.600	10.10.2023	116,21
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	18.013.500	USD	-19.325.117	10.10.2023	-244.497,24
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	216.355	EUR	-204.300	10.10.2023	-47,99
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	364.097	EUR	-346.300	10.10.2023	-2.716,86
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	156.982	CHF	-144.200	10.10.2023	-827,35
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	371.036	EUR	-350.600	10.10.2023	-333,27
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	43.400	USD	-46.309	10.10.2023	-337,95
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	158.813	CHF	-142.300	10.10.2023	3.077,75
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	27.528.500	USD	-30.957.494	10.10.2023	-830.634,43
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>					
EUR	18.057.000	USD	-19.278.283	24.10.2023	-140.156,63
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	26.929.600	USD	-29.809.297	24.10.2023	-294.105,68
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					

**Technische Daten und Erläuterungen (Fortsetzung)****Devisentermingeschäfte**

<b>Käufe</b>	<b>Verkäufe</b>		<b>Fälligkeit</b>	<b>Bewertung</b>	
<i>Gegenpartei</i>				(In USD)	
USD	2.645.984	EUR	-2.400.000	09.11.2023	100.333,44
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften</b>					<b>-1.410.130,00</b>



**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		<b>30.09.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		388.612.902,40			
Bankguthaben und sonstige		5.245.809,06			
Forderungen aus Erträgen		5.382.012,94			
Andere Aktiva		3.420,52			
		<b>399.244.144,92</b>			
<b>Passiva</b>					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		75.558,15			
Rückstellungen für Aufwendungen		290.483,20			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		1.410.130,00			
		<b>1.776.171,35</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>397.467.973,57</b>			
<b>Teilfondsentwicklung</b>		<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>	<b>30.09.2021</b>	
<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>USD</b>	<b>397.467.973,57</b>	<b>839.498.506,89</b>	<b>1.911.599.748,37</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A - Ausschüttend	USD	74,63	72,34	105,46	
B - Thesaurierend	USD	126,13	117,59	164,13	
DA - Ausschüttend	USD	737,87	715,20	1.043,72	
DB - Thesaurierend	USD	1.190,55	1.095,34	1.509,52	
EA - Ausschüttend	USD	733,00	710,60	1.036,50	
EB - Thesaurierend	USD	1.213,38	1.124,05	1.559,04	
IA - Ausschüttend	USD	79,69	77,26	112,69	
IA25 - Ausschüttend	USD	/	731,67	1.067,30	
IB - Thesaurierend	USD	134,06	124,23	172,37	
MB - Thesaurierend	USD	1.307,91	1.208,01	1.670,46	
UA - Ausschüttend	USD	78,51	76,11	110,99	
UB - Thesaurierend	USD	113,77	105,54	146,58	
BH - Thesaurierend	CHF	98,25	95,75	136,07	
DBH - Thesaurierend	CHF	734,34	705,92	989,95	
EBH - Thesaurierend	CHF	718,45	695,74	982,46	
IAH - Ausschüttend	CHF	/	67,23	99,83	
IBH - Thesaurierend	CHF	104,66	101,39	143,22	
UBH - Thesaurierend	CHF	91,20	88,44	125,05	
BH - Thesaurierend	EUR	104,31	100,00	142,10	
DBH - Thesaurierend	EUR	740,17	700,09	981,68	
EBH - Thesaurierend	EUR	845,31	805,24	1.136,89	
IAH25 - Ausschüttend	EUR	/	648,60	964,59	
IBH - Thesaurierend	EUR	110,99	105,77	149,39	
MAH - Ausschüttend	EUR	/	704,47	/	
UBH - Thesaurierend	EUR	95,77	91,35	129,16	
DBH - Thesaurierend	GBP	/	751,57	1.040,51	
<b>Anzahl der Aktien im Umlauf</b>		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Aktien</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Aktien</b>
A - Ausschüttend	USD	542.675,553	863.584,678	30.274,026	351.183,151
B - Thesaurierend	USD	346.695,949	620.819,297	21.463,423	295.586,771
DA - Ausschüttend	USD	1.062,686	10.106,913	95,830	9.140,057
DB - Thesaurierend	USD	62.104,267	108.315,021	1.617,740	47.828,494
EA - Ausschüttend	USD	437,138	27.027,138	0,000	26.590,000
EB - Thesaurierend	USD	35.779,867	50.224,128	517,150	14.961,411

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung (Fortsetzung)**

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
IA - Ausschüttend	USD	551.789,884	1.025.395,902	15.570,420	489.176,438
IA25 - Ausschüttend	USD	0,000	76.128,873	0,000	76.128,873
IB - Thesaurierend	USD	203.783,729	406.246,376	21.079,481	223.542,128
MB - Thesaurierend	USD	9.375,337	104.845,737	6.108,632	101.579,032
UA - Ausschüttend	USD	55.050,253	127.703,890	838,686	73.492,323
UB - Thesaurierend	USD	96.102,150	206.621,689	3.076,300	113.595,839
BH - Thesaurierend	CHF	74.252,415	117.050,512	1.219,152	44.017,249
DBH - Thesaurierend	CHF	45.615,910	36.362,107	9.601,680	347,877
EBH - Thesaurierend	CHF	6.413,338	6.738,338	0,000	325,000
IAH - Ausschüttend	CHF	0,000	62.417,571	0,000	62.417,571
IBH - Thesaurierend	CHF	37.995,284	63.767,949	0,000	25.772,665
UBH - Thesaurierend	CHF	47.879,707	61.232,005	13.577,153	26.929,451
BH - Thesaurierend	EUR	177.447,598	227.863,614	57.602,999	108.019,015
DBH - Thesaurierend	EUR	4.711,881	38.163,500	5.501,672	38.953,291
EBH - Thesaurierend	EUR	1.262,427	1.675,845	0,000	413,418
IAH25 - Ausschüttend	EUR	0,000	1.616,950	0,000	1.616,950
IBH - Thesaurierend	EUR	48.705,258	55.925,982	0,000	7.220,724
MAH - Ausschüttend	EUR	0,000	46.507,325	0,000	46.507,325
UBH - Thesaurierend	EUR	69.820,046	123.646,498	7.178,373	61.004,825
DBH - Thesaurierend	GBP	0,000	657,926	0,000	657,926

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)**Für die Periode vom  
01.10.2022 bis zum  
30.09.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>839.498.506,89</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	31.896.074,62
Bankzinsen	343.173,15
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	543.692,72
	<b>32.782.940,49</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	3.509.674,25
Depotbank- und Depotgebühr	352.857,06
Verwaltungskosten	327.033,69
Druck- und Veröffentlichungskosten	58.590,41
Zinsen und Bankspesen	4.948,38
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	333.583,85
"Taxe d'abonnement"	167.383,59
	<b>4.754.071,23</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>28.028.869,26</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-127.629.719,51
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-169.872,50
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	9.286.134,27
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-3.769.913,86
	<b>-122.283.371,60</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-94.254.502,34</b>
<b>Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	156.686.275,05
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	2.634.027,15
	<b>159.320.302,20</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>65.065.799,86</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	40.555.454,59
Rücknahmen	-539.559.054,02
	<b>-499.003.599,43</b>
<b>Ausschüttung</b>	<b>-8.092.733,75</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>397.467.973,57</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Kaimaninseln	9,94
Grossbritannien	5,78
Luxemburg	5,43
Vereinigte Staaten	5,30
Mexiko	5,03
Südkorea	4,29
Niederlande	4,12
Thailand	3,85
Vereinigte Arabische Emirate	3,61
Indien	3,56
Argentinien	3,27
Britische Jungfernsinseln	3,17
Peru	3,12
Singapur	2,75
Türkei	2,58
Bermudas	2,54
Kolumbien	2,17
Indonesien	2,16
Saudi-Arabien	1,87
Kasachstan	1,86
Israel	1,82
Kanada	1,77
Brasilien	1,47
Mauritius	1,32
Spanien	1,27
Irland	1,07
Chile	1,06
Panama	0,98
Japan	0,96
Usbekistan	0,94
Ukraine	0,92
Hongkong	0,87
Österreich	0,81
Qatar	0,81
Isle Of Man	0,64
Supranational	0,52
Guatemala	0,51
Ungarn	0,50
Georgien	0,49
Bahrain	0,47
Malaysia	0,44
Australien	0,41
Südafrika	0,30
Oman	0,24
Philippinen	0,24
China	0,23
Nigeria	0,21
Dominikanische Republik	0,09
<b>Total</b>	<b>97,77</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	24,00
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	23,69
Petroleum	14,94
Telekommunikation	6,03
Energie- und Wasserversorgung	3,92
Länder und Zentralregierungen	3,79
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	3,69
Chemie	2,98
Immobilien	1,59
Edelmetalle und Edelsteine	1,45
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	1,35
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,10
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,08
Verkehr und Transport	1,06
Anlagefonds	0,93
Baustoffe und Bauindustrie	0,77
Diverse Dienstleistungen	0,75
Landwirtschaft und Fischerei	0,65
Verschiedene Konsumgüter	0,62
Supranationale Organisationen	0,52
Elektrische Geräte und Komponenten	0,49
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,49

Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,42
Nichteisenmetalle	0,33
Fahrzeuge	0,24
Elektronik und Halbleiter	0,23
Versicherungsgesellschaften	0,21
Tabak und alkoholische Getränke	0,18
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,18
Einzelhandel und Warenhäuser	0,13
Verschiedene Handelsunternehmen	0,00
<b>Total</b>	<b>97,77</b>

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

**Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)**

**Aufstellung des Wertpapierbestandes**

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>							
<b>Anleihen</b>							
USD ABU DHABI COMM BNK 3.5%/22-310327	4.500.000	4.203.765,00	1,06	USD ECOPETROL SA 6.875%/20-29.04.2030	1.750.000	1.599.482,50	0,40
USD ACCESS BANK PLC 6.125%/21-210926	1.000.000	850.420,00	0,21	USD ECOPETROL SA 8.625%/23-190129	1.000.000	1.005.380,00	0,25
USD ADECOAGRO SA 6%/17-21.09.2027	300.000	283.413,00	0,07	USD ECOPETROL SA 8.875%/23-130133	2.250.000	2.198.992,50	0,55
USD AEGEA FINANCE SARL 6.75%/22-200529	250.000	230.997,50	0,06	USD EIG PEARL HOLDINGS 4.387%/22-301146	1.000.000	727.930,00	0,18
USD AEROPUERTOS ARG S 2021 144A 8.5%/21-010831	1.250.000	1.191.150,00	0,30	USD EMBRAER NETHERLANDS FINA 7%/23-280730	800.000	795.112,00	0,20
USD AES PANAMA GENERATION HL 4.375%/20-31.05.2030	2.000.000	1.691.202,62	0,43	USD EMIRATES NBD BK PJSC SUB FF FRN/19-PERPET	3.000.000	2.964.120,00	0,75
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BA 3.994%/19-21.09.2027	2.500.000	2.047.225,00	0,52	USD EMPRESAS GEN ELEC 5.625%/21-081128	400.000	355.092,00	0,09
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU 5.75%/21-150633	2.000.000	1.418.860,00	0,36	USD ENERGEAN ISRAEL 8.5%/23-300933	1.000.000	1.000.960,00	0,25
USD AIA GROUP LTD 4.5%/16-180346	1.000.000	820.000,00	0,21	USD ENERGEAN ISRAEL FIN S 1 4.5%/21-300324	3.500.000	3.500.000,00	0,88
USD ALDAR INVESTMENT 4.875%/23-240533	1.600.000	1.524.480,00	0,38	USD ENFRAGEN ENERGIA SUR SA 5.375%/20-30.12.2030	2.500.000	1.784.375,00	0,45
USD ALFA BANK (ALFA BOND) (SUBORDINATED) 5.95%/19-15.04.2030	3.000.000	55.230,00	0,01	USD ENN ENERGY HOLDINGS LTD 2.625%/20-170930	5.000.000	4.025.200,00	1,01
USD ALFA BANK (ALFA BOND) (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	7.000.000	561.400,00	0,14	USD ERO COPPER CORP 6.5%/22-150230	500.000	433.860,00	0,11
USD ALFA SAB 144A 6.875%/14-25.03.2044	2.000.000	1.821.060,00	0,46	USD EXPORT-IMPORT BK THAIL 3.902%/22-020627	4.000.000	3.776.400,00	0,95
USD ALIBABA GROUP HOLDING 2.125%/21-090231	1.000.000	781.230,00	0,20	USD FIRST QUANTUM MINERALS L 6.875%/18-01.03.2026	3.500.000	3.401.790,00	0,86
USD ALIBABA GROUP HOLDING 3.15%/21-090251	2.000.000	1.135.200,00	0,29	USD FMG RESOURCES AUG 2006 4.375%/21-010431	2.000.000	1.642.240,00	0,41
USD ALPEK SA DE CV 3.25%/21-250231	500.000	392.935,00	0,10	USD FOMENTO ECONOMICO MEX 3.5%/20-16.01.2050	1.000.000	705.820,00	0,18
USD ALPEK SA DE CV 4.25%/19-180929	1.000.000	877.000,00	0,22	USD FORTUNE STAR BVI LTD 6.85%/20-02.07.2024	400.000	366.248,00	0,09
USD ALPHA STAR HLD VII 7.75%/23-270426	750.000	755.947,50	0,19	USD FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25%/19-23.07.2029	1.000.000	626.090,00	0,16
USD ALTICE FINANCING SA 5.75%/21-150829	2.250.000	1.847.002,50	0,46	USD FREEPORT INDONESIA 5.315%/22-140432	2.000.000	1.803.580,00	0,45
USD AMERICA MOVIL 4.375%/12-160742	500.000	403.260,00	0,10	USD FRESNILLO PLC 4.25%/20-02.10.2050	500.000	350.930,00	0,09
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.625%/19-220429	1.500.000	1.351.395,00	0,34	USD FRONTERA ENERGY CORP 7.875%/21-210628	3.000.000	2.382.690,00	0,60
USD ANGL O AMERICAN CAP 4.75%/22-160352	250.000	190.502,50	0,05	USD FS LUXEMBOURG SARL 10%/20-15.12.2025	250.000	256.637,50	0,06
USD ANGL O AMERICAN CAPITAL 2.625%/20-100930	750.000	599.430,00	0,15	USD GAZPROM PJSC (GAZ FN) 3%/20-29.06.2027	760.000	539.774,80	0,14
USD ANGL O GOLD PLC 3.375%/21-011128	3.000.000	2.538.660,00	0,64	USD GC TREASURY CENTRE CO 4.4%/22-300332	1.500.000	1.282.425,00	0,32
USD ARABIAN CENTRES SUKUK 5.625%/21-071026	2.000.000	1.825.590,00	0,46	USD GEMDALE EVER PROSPERITY 4.95%/21-120824	1.000.000	439.930,00	0,11
USD ARAGVI FINANCE INTL 8.45%/21-290426	2.000.000	1.374.140,00	0,35	USD GEOPARK LTD 5.5%/20-17.01.2027	2.500.000	2.139.700,00	0,54
USD AUNA SA 6.5%/20-20.11.2025	3.000.000	2.753.370,00	0,69	USD GLP CHINA HOLDINGS LTD 2.95%/21-290326	500.000	309.770,00	0,08
USD AXIAN TELECOM 7.375%/22-160227	3.000.000	2.697.240,00	0,68	USD GOLD FIELDS OROGEN HOLD 5.125%/19-15.05.2024	2.000.000	1.985.200,00	0,50
USD AYDEM YENILENEBILIR ENER 7.75%/21-020227	500.000	443.435,00	0,11	USD GOLD FIELDS OROGEN HOLD 6.125%/19-15.05.2029	2.000.000	1.949.120,00	0,49
USD B3 SA-BRASIL BOL SA BALC 4.125%/21-200931	750.000	622.792,50	0,16	USD GRAN TIERRA ENERGY INC 7.75%/19-23.05.2027	750.000	650.467,50	0,16
USD BAIDU INC 4.875%/18-14.11.2028	2.000.000	1.924.200,00	0,48	USD GRAN TIERRA ENERGY INTL 6.25%/18-150225	750.000	709.402,50	0,18
USD BAKRIE TELECOM (REG. -S-) 11.5%/10-07.05.2015	2.500.000	19.325,00	0,00	USD GREENKO DUTCH BV 3.85%/21-290326	3.000.000	2.505.852,75	0,63
USD BANCO DE CHILE 2.99%/21-091231	2.500.000	2.048.175,00	0,52	USD GREENSAIF PIPELINES BID 6.129%/23-220328	1.750.000	1.717.782,50	0,43
USD BANCO DE CREDITO DEL PER 3.25%/21-300931	3.500.000	3.099.705,00	0,78	USD GREENTOWN CHINA HLDGS 4.7%/20-29.04.2025	1.000.000	777.130,00	0,20
USD BANCO DO BRASIL REG S FF 6.25%/13-PERPET	3.000.000	2.766.600,00	0,70	USD GRUPO BIMBO REG S 4.875%/14-270644	1.000.000	830.840,00	0,21
USD BANCO GENERAL SA SUB FF FRN/21-PERPET	2.500.000	2.222.300,00	0,56	USD GULF INTERNATIONAL BANK 2.375%/20-23.09.2025	2.000.000	1.860.980,00	0,47
USD BANCO INDUSTRIAL SA SUB FF FRN/21-290131	500.000	463.080,00	0,12	USD GUSAP III LP 4.25%/19-21.01.2030	500.000	452.650,00	0,11
USD BANCO INT DEL PERU SUB FF FRN/20-080730	1.250.000	1.156.662,50	0,29	USD HANA BANK 3.25%/22-300327	4.000.000	3.711.640,00	0,93
USD BANCO MERCANTIL FF FRN/21-PERPET	3.250.000	2.777.905,00	0,70	USD HIDROVIAS INT FIN SARL 4.95%/21-08.02.2031	1.250.000	1.002.850,00	0,25
USD BANCOLOMBIA SA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-18.12.2029	2.250.000	1.946.205,00	0,49	USD HIKMA FINANCE USA LLC 3.25%/20-09.07.2025	500.000	474.620,00	0,12
USD BANGKOK BANK PCL/HK SUB FF FRN/19-250934	4.500.000	3.756.825,00	0,95	USD HKT CAPITAL NO 6 LTD 3%/22-180132	4.500.000	3.627.765,00	0,91
USD BANK LEUMI LE-ISRAEL FF FRN/20-290131	1.500.000	1.341.180,00	0,34	USD HUARONG FINANCE 2017 CO 4.75%/17-27.04.2027	1.500.000	1.286.100,00	0,32
USD BANK MUSCAT S 7 4.75%/21-170326	1.000.000	962.380,00	0,24	USD HUARONG FINANCE 2019 3.75%/19-29.05.2024	1.500.000	1.451.220,00	0,37
USD BANK OF EAST ASIA FRN/22-220432	1.250.000	1.091.312,50	0,27	USD IHS HOLDING LTD 5.625%/21-291126	3.000.000	2.482.980,00	0,62
USD BANK OF EAST ASIA LTD (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	1.000.000	804.030,00	0,20	USD IND&COMM BK OF CHN SUB FF FRN/21-PERPET	1.000.000	919.510,00	0,23
USD BANK OF GEORGIA JSC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	1.000.000	990.460,00	0,25	USD INDOFOOD CBP SUKSES MAK 3.398%/21-090631	3.500.000	2.820.930,00	0,71
USD BARTRONICS INDIA (REG. -S-) 0%/08-04.02.2013	1.300.000	130,00	0,00	USD INDUSTRIAS PENOLES SAB D 4.15%/19-12.09.2029	1.600.000	1.408.864,00	0,35
USD BBANCO MERCANTIL DE NOR SUB FF FRN/PERPE	750.000	728.617,50	0,18	USD INKIA ENERGY LTD 5.875%/17-091127	500.000	480.490,00	0,12
USD BBVA BANCOMER SA 8.45%/23-290638	750.000	739.222,50	0,19	USD INTL AIRPORT FINANCE SA 12%/19-150333	2.000.000	1.831.092,78	0,46
USD BHARTI AIRTEL REGS 4.375%/15-100625	2.000.000	1.950.800,00	0,49	USD INVERSIONES CMPC SA 6.125%/23-230633	500.000	486.895,00	0,12
USD BOC AVIATION LTD 3.5%/19-10.10.2024	1.500.000	1.460.205,00	0,37	USD IPOTEKA-BANK ATIB 5.5%/20-19.11.2025	1.500.000	1.599.325,00	0,40
USD BRASKEM IDESA SAPI 6.99%/21-200232	250.000	150.967,50	0,04	USD ITAU UNIBANCO REG S FF 6.125%/17-PERPET	2.000.000	1.941.320,00	0,49
USD BRASKEM IDESA SAPI 7.45%/19-15.11.2029	250.000	156.942,50	0,04	USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO 5.375%/18-24.04.2030	4.000.000	3.640.480,00	0,92
USD BRASKEM NETHERLANDS B.V. 4.5%/19-31.01.2030	1.500.000	1.221.870,00	0,31	USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (REG. -S-) 4.75%/17-19.04.2027	4.000.000	3.750.040,00	0,94
USD BRF SA 4.875%/19-24.01.2030	450.000	365.260,50	0,09	USD KENBOURNE INVEST SA 4.7%/21-22.01.2028	2.500.000	1.558.725,00	0,39
USD C&W SENIOR FINANCING DAC 6.875%/150927	2.000.000	1.767.740,00	0,44	USD KENBOURNE INVEST SA 6.875%/19-261124	1.000.000	837.940,00	0,21
USD CAMPOSOL SA 6%/20-030227	3.000.000	1.783.170,00	0,45	USD KLABIN AUSTRIA GMBH 3.2%/21-120131	1.500.000	1.178.130,00	0,30
USD CANACOL ENERGY LTD 5.75%/21-241128	1.000.000	815.040,00	0,21	USD KONDOR FINANCE PLC (NAK) 7.125%/19-19.07.2024	3.750.000	1.911.745,17	0,48
USD CBO FINANCE LTD 2%/20-15.09.2025	5.000.000	4.616.900,00	1,16	USD KONDOR FINANCE PLC (NAK) 7.625%/19-08.11.2026	2.000.000	973.840,00	0,25
USD CEAGRO AGRICOLA (REG. -S-) 10.75%/10-16.05.2016	2.000.000	132.060,00	0,03	USD KOOKMIN BANK SUB 4.5%/19-010229	4.000.000	3.692.680,00	0,93
USD CEMEX SAB DE CV SUB FF FRN/23-PERPET	1.250.000	1.302.587,50	0,33	USD KOSMOS ENERGY LTD 7.125%/19-04.04.2026	3.000.000	2.830.800,00	0,71
USD CENCOSUD SA 6.625%/15-120245	500.000	504.165,00	0,13	USD LAMAR FUNDING REG S 3.958%/15-070525	750.000	717.135,00	0,18
USD CENTRAL CHN REAL ESTATE 7.5%/21-14.07.2025	3.500.000	134.155,00	0,03	USD LEVIATHAN BOND LTD 144A 6.75%/20-300630	1.500.000	1.386.915,00	0,35
USD CIA DE MINAS BUENAVENTUR 5.5%/21-230726	550.000	482.531,50	0,12	USD LG CHEM LTD 4.375%/22-140725	4.500.000	4.375.440,00	1,10
USD CIMB BANK BHD 2.125%/22-200727	2.000.000	1.767.140,00	0,44	USD LIBERTY COSTA RICA SR 10.875%/23-150131	1.000.000	1.003.710,00	0,25
USD CK HUTCHISON INTL 23 4.75%/23-210428	1.500.000	1.445.430,00	0,36	USD LIMA METRO LINE 2 FIN LT 5.875%/15-05.07.2034	1.500.000	654.030,33	0,16
USD COLBUN SA 3.15%/20-06.03.2030	500.000	416.965,00	0,10	USD LIQUID TELECOM FINANCE 5.5%/21-040926	3.750.000	2.411.212,50	0,61
USD CSN ISLANDS XI CORP 6.75%/20-28.01.2028	750.000	697.005,00	0,18	USD MAF GLOBAL SECURITIES SUB FF FRN/PERPET	2.000.000	2.016.720,00	0,51
USD CSN RESOURCES SA 5.875%/22-080432	250.000	203.130,00	0,05	USD MC BRAZIL DWINSTRM 7.25%/21-300631	400.000	297.315,62	0,07
USD CT TRUST 5.125%/22-030232	2.000.000	1.579.020,00	0,40	USD MDGH GMTN RSC LTD 2.5%/21-030631	3.000.000	2.474.490,00	0,62
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LT 6.75%/19-15.02.2025	1.000.000	990.630,00	0,25	USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.25%/19-250329	3.000.000	2.302.344,00	0,58
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LT 8%/23-250229	750.000	746.640,00	0,19	USD MINERVA LUXEMBOURG SA 4.375%/21-180331	2.250.000	1.747.800,00	0,44
USD DBS GRP HOLDINGS SUB 17 FF FRN/18-11.12.28	3.500.000	3.488.590,00	0,88	USD MINSUR SA 4.5%/21-281031	1.500.000	1.265.600,00	0,32
USD DESARROLLADORA METROPOLITANA (REG. -S-) 10.875%/07-09.05.2017	300.000	54,00	0,00	USD MIZUHO FINANCIAL GROUP FF FRN/19-160730	4.500.000	3.834.360,00	0,96
USD DIB SUKUK LTD 2.95%/20-16.01.2026	5.000.000	4.714.450,00	1,19	USD MTN MAURITIUS INVSTMENTS 6.5%/16-131026	1.250.000	1.228.175,00	0,31
USD DIGICEL REG S 6.75%/15-010323	5.000.000	173.900,00	0,04	USD MX REMIT FUND FIDUC EST 4.875%/21-15.01.2028	3.000.000	2.427.003,00	0,61
USD ECOPETROL 5.875%/14-28.05.2045	2.000.000	1.323.240,00	0,33	USD NEMAK SAB DE CV 3.625%/21-280631	1.250.000	935.687,50	0,24
				USD NEXA RESOURCES S.A. 6.5%/20-18.01.2028	2.000.000	1.902.980,00	0,48
				USD NOBLE GRP HLD LTD (SUBORDINATED) 2.5%/18-PERPETUAL	187.500	77.445,00	0,02
				USD OLEODUCTO CENTRAL SA 4%/20-140727	631.000	564.442,12	

## Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD OREDOO INTL FINANCE 2.625%/21-080431	3.000.000	2.499.840,00	0,63
USD ORAZUL ENERGY EGENOR 5.625%/17-280427	1.079.000	985.245,69	0,25
USD OTP BANK NYRT SUB FF FRN/23-150533	2.000.000	1.982.900,00	0,50
USD PAMPA ENERGIA REG S 7.5%/17-240127	750.000	702.645,00	0,18
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5.093%/20-150130	250.000	231.727,50	0,06
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 6.85%/15-05.06.2115	750.000	641.557,50	0,16
USD PETROBRAS INTL FIN 6.875%/09-200140	750.000	716.145,00	0,18
USD PHILIPPINE NATIONAL BANK 3.280%/19-27.09.2024	1.000.000	971.390,00	0,24
USD POWER FINANCE S 2 5.25%/18-100828	2.000.000	1.929.720,00	0,49
USD PROSUS N.V. 3.257%/22-190127	2.750.000	2.441.532,50	0,61
USD PROSUS NV 3.061%/21-190731	3.750.000	2.795.737,50	0,70
USD PT BANK MANDIRI (PERSERO) TBK 3.75%/19-11.04.2024	4.000.000	3.951.440,00	0,99
USD PITTEP TREASURY CENTER COMPANY LTD 2.587%/20-10.06.2027	3.000.000	2.698.950,00	0,68
USD QATAR PETROLEUM 2.25%/21-120731	4.000.000	3.209.840,00	0,81
USD ONB FINANCE LTD 1.375%/21-26.01.2026	4.000.000	3.623.160,00	0,91
USD RELIANCE INDUSTRIES 3.625%/22-120132	3.000.000	2.391.180,00	0,60
USD RELIANCE INDUSTRIES 3.625%/22-120152	1.500.000	961.185,00	0,24
EUR REPUBLIC OF ARGENTINA 0.5%/20-09.07.2029	134.327	34.168,04	0,01
USD REPUBLIC OF ARGENTINA 1%/20-09.07.2029	47.431	13.039,73	0,00
EUR REPUBLIC OF ARGENTINA STEP-UP/20-09.01.2038	2.187.234	593.684,72	0,15
EUR REPUBLIC OF ARGENTINA STEP-UP/20-09.07.2046	4.495.271	1.090.038,10	0,27
USD REPUBLIC OF ARGENTINA STEP-UP/20-090138	1.860.936	547.115,18	0,14
USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.125%/21-260726	4.000.000	1.327.080,00	0,33
USD RUMO LUXEMBOURG SARL 4.2%/21-180132	1.500.000	1.175.580,00	0,30
USD RUSSIAN STANDARD 13% 15-20.10.2022	4.558.282	1.11.659,18	0,03
USD SABLE INTL FINANCE LTD 5.75%/19-070927	500.000	454.300,00	0,11
USD SASOL FINANCING USA LLC 4.375%/21-180926	1.100.000	976.635,00	0,25
USD SASOL FINANCING USA LLC 6.5%/18-27.09.2028	2.500.000	2.235.300,00	0,56
USD SAUDI ARABIAN OIL CO 3.25%/20-24.11.2050	1.500.000	936.960,00	0,24
USD SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 3.5%/19-16.04.2029	4.500.000	4.062.870,00	1,02
USD SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 4.25%/19-16.04.2039	3.000.000	2.441.610,00	0,61
USD SHINHAN BANK SUB 4.375%/22-130432	5.000.000	4.372.950,00	1,10
USD SHUI ON DEVELOPMENT HLDG 5.5%/21-290626	1.500.000	658.675,00	0,17
USD SIERRACOL ENRGY ANDINA 6%/21-150628	2.500.000	1.995.875,00	0,50
USD SIMPAR EUROPE SA 5.2%/21-26.01.2031	500.000	403.140,00	0,10
USD SK HYNIX INC 1.5%/21-19.01.2026	1.000.000	898.900,00	0,23
USD SOVCOMBANK (SOVCOM CAPT) (SUBORDINATED) 8%/19-07.04.2030	1.200.000	83.904,00	0,02
USD SOVCOMBANK (SOVCOM CAPT) (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	2.000.000	38.800,00	0,01
USD SOVCOMBANK (SOVCOM CAPT) SUB FF FRN/21-PERPETUAL	8.500.000	368.135,00	0,09
USD STANDARD CHARTERED FF FRN/23-060734	1.500.000	1.448.910,00	0,36
USD STANDARD CHARTERED FF FRN/23-090127	3.000.000	2.986.800,00	0,75
USD STANDARD CHARTERED PLC FRN/21-290632	3.000.000	2.291.850,00	0,58
USD STANDARD CHARTERED PLC SUB FF FRN/PERPET	500.000	363.480,00	0,09
USD STATE BANK OF INDIA 2.49%/22-260127	4.500.000	4.070.610,00	1,02
USD STILLWATER MINING CO 4.5%/21-161129	2.250.000	1.731.082,50	0,44
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75%/20-15.01.2031	2.500.000	2.060.350,00	0,52
USD TBC BANK JSC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	1.000.000	970.710,00	0,24
USD TELECOM ARGENTINA SA -144A- 8.5%/20-06.08.2025	1.225.000	805.336,32	0,20
USD TELECOM ARGENTINA SA 8.5%/20-06.08.2025	1.140.000	749.455,84	0,19
USD TELEFONICA CHILE 3.537%/21-181131	1.000.000	751.730,00	0,19
USD TENCENT HOLDINGS LTD 3.24%/20-030650	1.000.000	576.030,00	0,14
USD TENCENT HOLDINGS LTD 3.975%/19-11.04.2029	5.500.000	4.994.385,00	1,26
USD TERMOCANDELARIA POWER 7.875%/19-30.01.2029	2.000.000	1.460.084,50	0,37
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 3.15%/16-01.10.2026	2.250.000	2.008.080,00	0,51
USD TEVA PHARMACEUTICALS NE 5.125%/21-090529	2.000.000	1.817.160,00	0,46
USD THAI OIL TREASURY CENTER COMPANY LTD 2.5%/20-18.06.2030	1.500.000	1.174.380,00	0,30
USD THAI OIL TRSRY CENTER 5.375%/18-201148	3.250.000	2.597.887,50	0,65
USD TOTAL PLAY TELECOM 6.375%/21-200928	3.500.000	1.726.025,00	0,43
USD TRANSNET SOC LTD 8.25%/23-060228	1.250.000	1.198.387,50	0,30
USD TRANSPORT DE GAS DEL SUR 6.75%/18-02.05.2025	1.750.000	1.645.227,50	0,41
USD TRUST F/1401 4.869%/19-15.01.2030	3.000.000	2.540.100,00	0,64
USD TRUST F/1401 6.39%/19-15.01.2050	1.500.000	1.149.360,00	0,29
USD TULLOW OIL PLC 10.25%/21-150526	800.000	696.680,00	0,18
USD TULLOW OIL PLC 7%/18-010325	3.250.000	2.510.365,00	0,63
USD TUPRAS-TURKIYE PETROL RA 4.5%/17-18.10.2024	2.500.000	2.424.300,00	0,61
USD TUPY OVERSEAS SA 4.5%/21-16.02.2031	1.000.000	805.970,00	0,20
USD TURK SISE VE CAM FABRIKA 6.95%/19-140326	1.750.000	1.706.040,00	0,43
USD TURKCELL REG S 5.75%/15-151025	2.500.000	2.422.375,00	0,61
USD UKRAINE (REG. -S-) FRN 15-31.05.2040	4.500.000	2.082.240,00	0,52
USD UKRAINE GOVERNMENT 6.876%/21-210529	3.750.000	1.001.587,50	0,25
USD UKRAINE RAIL 7.875%/21-150726	3.750.000	1.779.037,50	0,45
USD UPL CORP LTD 4.5%/18-08.03.2028	1.500.000	1.303.995,00	0,33
USD UZBEK INDUSTRIAL AND CON 5.75%/19-02.12.2024	2.250.000	2.144.947,50	0,54
USD VEDANTA RESOURCES 8.95%/21-110325	4.000.000	2.963.120,00	0,75
USD VFU FUNDING (VF UKRAINE) 6.2%/20-110225	750.000	562.477,50	0,14

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD VOLCAN CIA MINERA SAA-CM 4.375%/21-11.02.2026	1.500.000	863.790,00	0,22
USD YPF (REG -S-) 8.5%/15-28.07.2025	2.000.000	1.790.580,00	0,45
USD YPF ENERGIA ELECTRICA SA 10%/19-25.07.2026	1.500.000	1.408.860,00	0,35
USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 6.95%/17-21.07.2027	3.000.000	2.410.680,00	0,61
<b>Total Anleihen</b>		<b>360.395.359,49</b>	<b>90,67</b>

**Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere** **360.395.359,49** **90,67**

## Nicht börsennotierte Wertpapiere

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD AEGEA FINANCE S.A.R.L. 9%/23-200131	850.000	856.893,50	0,22
USD ANGLO AMERICAN 5.5%/23-020533	1.000.000	936.930,00	0,24
USD ARCELIK AS 8.5%/23-250928	750.000	751.185,00	0,19
USD COSAN LUXEMBOURG 7.5%/23-270630	1.000.000	997.500,00	0,25
USD FIRST ABU DHABI BANK 4.774%/23-060628	2.500.000	2.438.625,00	0,61
USD HDFC BANK LTD 5.686%/23-020326	2.850.000	2.850.513,00	0,72
USD PETROBRAS GLOBAL 6.5%/23-030733	1.250.000	1.194.075,00	0,30
USD TURKIYE SINAI A.S. 9.375%/23-191028	1.250.000	1.257.950,00	0,32
USD TURKIYE VAKIFLAR T.A.O. 9%/23-121028	1.250.000	1.241.437,50	0,31
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD FRN/22-071032	6.500.000	5.980.845,00	1,50
<b>Total Anleihen</b>		<b>18.505.954,00</b>	<b>4,66</b>

**Nicht börsennotierte Wertpapiere** **18.505.954,00** **4,66**

## Geldmarktinstrumente

USD TREASURY BILL 0%/23-180424	10.000.000	9.711.588,91	2,44
--------------------------------	------------	--------------	------

**Total Geldmarktinstrumente** **9.711.588,91** **2,44**

**Total des Wertpapierbestandes** **388.612.902,40** **97,77**

Bankguthaben und sonstige 5.245.809,06 1,32

Bankverbindlichkeiten und sonstige -75.558,15 -0,02

Anderes Nettovermögenswerte 3.684.820,26 0,93

**Teilfondsvermögen** **397.467.973,57** **100,00**

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

## Technische Daten und Erläuterungen

### Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	USD	12471998	LU0592661523	1,00%	1,23%
DA - Ausschüttend	USD	49881765	LU2039695973	0,00%	0,12%
DB - Thesaurierend	USD	23853666	LU1041505519	0,00%	0,12%
EB - Thesaurierend	USD	23175711	LU1009467009	0,40%	0,60%
IA - Ausschüttend	USD	36438322	LU1598841127	0,50%	0,73%
IB - Thesaurierend	USD	12472003	LU0592661879	0,50%	0,73%
MB - Thesaurierend	USD	27225618	LU1195379596	0,30%	0,50%
UB - Thesaurierend	USD	26312135	LU1144397038	0,60%	0,83%
BH - Thesaurierend	CHF	12472012	LU0592662331	1,00%	1,31%
DBH - Thesaurierend	CHF	23853667	LU1041505949	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	CHF	23176306	LU1009467850	0,40%	0,68%
IBH - Thesaurierend	CHF	12472014	LU0592662414	0,50%	0,81%
UBH - Thesaurierend	CHF	26314139	LU1144397111	0,60%	0,91%
BH - Thesaurierend	EUR	12472005	LU0592662091	1,00%	1,31%
DAH - Ausschüttend	EUR	122404523	LU2546465555	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	EUR	23176195	LU1009467421	0,40%	0,68%
IBH - Thesaurierend	EUR	12472007	LU0592662174	0,50%	0,82%
UBH - Thesaurierend	EUR	26314142	LU1144397202	0,60%	0,91%

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die DA-Aktienklasse, DB-Aktienklasse, DAH-Aktienklasse und DBH-Aktienklasse.  
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund -DAH- EUR wurde am 21.10.2022 lanciert.

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	USD	0,51%	/	-15,70%	-1,56%	7,23%
DA - Ausschüttend	USD	1,35%	/	-14,79%	-0,48%	8,40%
DB - Thesaurierend	USD	1,35%	/	-14,79%	-0,48%	8,40%
EB - Thesaurierend	USD	0,98%	/	-15,17%	-0,92%	7,92%
IA - Ausschüttend	USD	0,88%	/	-15,28%	-1,06%	7,77%
IB - Thesaurierend	USD	0,88%	/	-15,28%	-1,06%	7,76%
MB - Thesaurierend	USD	1,06%	/	-15,09%	-0,82%	8,03%
UB - Thesaurierend	USD	0,81%	/	-15,37%	-1,16%	7,72%
BH - Thesaurierend	CHF	-2,67%	/	-18,12%	-2,62%	5,00%
DBH - Thesaurierend	CHF	-1,81%	/	-17,20%	-1,51%	6,20%
EBH - Thesaurierend	CHF	-2,20%	/	-17,61%	-1,98%	5,68%
IBH - Thesaurierend	CHF	-2,29%	/	-17,72%	-2,12%	5,50%
UBH - Thesaurierend	CHF	-2,38%	/	-17,80%	-2,22%	5,42%
BH - Thesaurierend	EUR	-1,33%	/	-17,66%	-2,43%	5,28%
DAH - Ausschüttend	EUR	-0,45%	5,00%	/	/	/
EBH - Thesaurierend	EUR	-0,86%	/	-17,15%	-1,81%	5,96%
IBH - Thesaurierend	EUR	-0,94%	/	-17,25%	-1,94%	5,81%
UBH - Thesaurierend	EUR	-1,03%	/	-17,34%	-2,04%	5,24%

### Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
DA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	8,02
DA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	8,16
DA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	8,27
DA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	8,23
IA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	7,08
IA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	7,20
IA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	7,26
IA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	7,23
DAH - Ausschüttend	EUR	07.02.2023	7,41
DAH - Ausschüttend	EUR	02.05.2023	10,15
DAH - Ausschüttend	EUR	01.08.2023	10,18

**Technische Daten und Erläuterungen (Fortsetzung)****Erläuterungen****Finanzterminkontrakte**

Beschreibung	Währung	Anzahl	Verpflichtungen (in Währung des Terminkontrakts)	Bewertung (in USD)
<i>Gegenpartei</i>				
ULTRA T-BOND USD -100000- 19/12/23	USD	55	6.527.812,50	-473.515,63
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 19/12/23	USD	130	14.048.125,00	-267.109,44
US TREASURY NOTES 5 YEARS -100000- 29/12/23	USD	200	21.071.875,00	-181.250,00
US TREASURY NOTES ULTRA 10 YEARS -10000- 19/12/23	USD	100	11.156.250,00	-194.531,25

**Nichtrealisierter Nettoverlust aus Finanzterminkontrakten****-1.116.406,32***Gegenpartei : Credit Suisse (Schweiz) AG***Devisentermingeschäfte**

Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Bewertung (in USD)
<i>Gegenpartei</i>			
USD 112.662 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	CHF -102.800	10.10.2023	158,96
USD 917.126 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	EUR -866.100	10.10.2023	-281,35
USD 202.115 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	CHF -181.100	10.10.2023	3.916,94
EUR 38.614.900 <i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>	USD -41.426.567	10.10.2023	-524.120,03
USD 268.505 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	EUR -253.600	10.10.2023	-117,87
USD 2.960 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	EUR -2.800	10.10.2023	-6,28
USD 12.709 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	CHF -11.500	10.10.2023	123,10
USD 178.835 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	CHF -159.700	10.10.2023	4.056,35
CHF 81.975.100 <i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>	USD -92.186.051	10.10.2023	-2.473.485,33
CHF 65.600 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	USD -71.921	10.10.2023	-129,46
USD 25.142 <i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>	EUR -23.500	10.10.2023	249,70
EUR 37.964.900 <i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>	USD -40.532.652	24.10.2023	-294.679,76
CHF 80.018.600 <i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>	USD -88.575.331	24.10.2023	-873.905,47

**Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften****-4.158.220,50****Swapkontrakte**

Art	Verbindlichkeiten	Forderungen	Fälligkeit	Bewertung (in USD)
<i>Gegenpartei</i>				
CDS USD 10.000.000 <i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>	Protection premium	REPUBLIC OF CHILE SNR	20.12.2028	-123.745,48

*JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich***Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten****-123.745,48**



**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		<b>30.09.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		780.000.599,71			
Bankguthaben und sonstige		5.763.679,00			
Forderungen aus Erträgen		9.745.773,03			
Andere Aktiva		62,46			
		<b>795.510.114,20</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		283.160,45			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Finanzterminkontrakten		1.116.406,32			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten		123.745,48			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		4.158.220,50			
		<b>5.681.532,75</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>789.828.581,45</b>			
<b>Teilfondsentwicklung</b>		<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>	<b>30.09.2021</b>	
<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>USD</b>	<b>789.828.581,45</b>	<b>980.058.668,29</b>	<b>1.583.883.459,18</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
B - Thesaurierend	USD	133,05	127,74	158,07	
DA - Ausschüttend	USD	823,94	813,57	1.032,55	
DB - Thesaurierend	USD	1.207,14	1.146,20	1.403,16	
EB - Thesaurierend	USD	1.224,15	1.167,92	1.436,09	
IA - Ausschüttend	USD	858,81	848,06	1.076,04	
IB - Thesaurierend	USD	140,59	134,32	165,37	
MB - Thesaurierend	USD	1.035,43	986,89	1.212,26	
UB - Thesaurierend	USD	112,28	107,37	132,33	
BH - Thesaurierend	CHF	104,37	104,79	132,21	
DBH - Thesaurierend	CHF	968,60	961,31	1.199,24	
EBH - Thesaurierend	CHF	923,42	921,32	1.155,02	
IBH - Thesaurierend	CHF	110,25	110,13	138,25	
UBH - Thesaurierend	CHF	89,78	89,79	112,83	
BH - Thesaurierend	EUR	111,04	109,57	137,93	
DAH - Ausschüttend	EUR	1.022,88	/	/	
EBH - Thesaurierend	EUR	1.011,25	991,63	1.240,38	
IBH - Thesaurierend	EUR	117,51	115,37	144,49	
UBH - Thesaurierend	EUR	93,88	92,28	115,69	
<b>Anzahl der Aktien im Umlauf</b>		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Aktien</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Aktien</b>
B - Thesaurierend	USD	119.479,074	169.363,500	33.291,987	83.176,413
DA - Ausschüttend	USD	6.487,417	46.052,835	12.222,221	51.787,639
DB - Thesaurierend	USD	157.577,493	180.180,859	43.375,613	65.978,979
EB - Thesaurierend	USD	99.932,658	121.848,004	11.924,040	33.839,386
IA - Ausschüttend	USD	8.414,671	10.195,802	1.758,463	3.539,594
IB - Thesaurierend	USD	488.130,880	717.035,044	91.955,520	320.859,684
MB - Thesaurierend	USD	117.558,518	213.240,920	9.261,844	104.944,246
UB - Thesaurierend	USD	38.677,034	69.380,452	956,854	31.660,272
BH - Thesaurierend	CHF	22.300,051	25.998,051	2.010,000	5.708,000
DBH - Thesaurierend	CHF	136.234,195	166.781,509	11.986,054	42.533,368
EBH - Thesaurierend	CHF	24.171,598	20.823,432	7.288,819	3.940,653
IBH - Thesaurierend	CHF	25.688,998	45.628,426	190,000	20.129,428
UBH - Thesaurierend	CHF	4.672,345	5.978,929	140,345	1.446,929

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung (Fortsetzung)**

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
BH - Thesaurierend	EUR	35.150,406	56.635,447	3.485,851	24.970,892
DAH - Ausschüttend	EUR	33.110,000	0,000	35.010,000	1.900,000
EBH - Thesaurierend	EUR	33.199,052	42.052,252	8.265,839	17.119,039
IBH - Thesaurierend	EUR	15.113,446	81.618,658	170,000	66.675,212
UBH - Thesaurierend	EUR	19.702,119	25.516,119	0,000	5.814,000

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)**Für die Periode vom  
01.10.2022 bis zum  
30.09.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>980.058.668,29</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	38.152.490,08
Bankzinsen	550.781,90
	<b>38.703.271,98</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	2.488.893,12
Depotbank- und Depotgebühr	547.830,11
Verwaltungskosten	357.900,40
Druck- und Veröffentlichungskosten	51.822,63
Zinsen und Bankspesen	2.661,85
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	329.767,68
"Taxe d'abonnement"	103.813,50
	<b>3.882.689,29</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>34.820.582,69</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-57.081.606,58
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-2.114.665,86
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	34.345,15
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	18.993.185,85
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-7.308.636,88
	<b>-47.477.378,32</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-12.656.795,63</b>
<b>Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	75.428.410,49
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	-173.281,32
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-155.162,32
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	489.669,38
	<b>75.589.636,23</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>62.932.840,60</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	171.901.063,30
Rücknahmen	-422.330.764,66
	<b>-250.429.701,36</b>
<b>Ausschüttung</b>	<b>-2.733.226,08</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>789.828.581,45</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Kaimaninseln	14,55
Mexiko	8,75
Vereinigte Arabische Emirate	7,08
Südkorea	5,68
Indonesien	5,07
Britische Jungferninseln	4,78
Chile	4,49
Peru	3,78
Indien	3,72
Grossbritannien	3,67
Niederlande	3,41
Thailand	3,32
Saudi-Arabien	3,09
Vereinigte Staaten	2,82
Kolumbien	2,39
Singapur	2,37
Malaysia	2,13
Japan	1,93
Bermudas	1,79
Supranational	1,55
Kasachstan	1,53
Kanada	1,48
Bahrain	1,41
Isle Of Man	1,37
Hongkong	1,33
Panama	1,25
Israel	1,11
Luxemburg	1,08
Qatar	0,65
Marshallinseln	0,55
Mauritius	0,31
Jersey	0,19
Österreich	0,12
<b>Total</b>	<b>98,76</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	27,48
Banken und andere Kreditinstitute	24,32
Petroleum	10,57
Chemie	5,90
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	5,25
Diverse Dienstleistungen	3,62
Energie- und Wasserversorgung	3,05
Edelmetalle und Edelsteine	2,10
Länder und Zentralregierungen	1,93
Telekommunikation	1,76
Verkehr und Transport	1,68
Supranationale Organisationen	1,55
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,41
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	1,25
Anlagefonds	0,96
Einzelhandel und Warenhäuser	0,94
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	0,84
Computerhardware und Netzwerk	0,83
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,70
Baustoffe und Bauindustrie	0,62
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,60
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,55
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,46
Versicherungsgesellschaften	0,39
<b>Total</b>	<b>98,76</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Anleihen</b>			
USD ABO FINANCE 2%/21-060726	3.000.000	2.704.740,00	0,34
USD ABU DHABI COMM BNK 3.5%/22-310327	9.000.000	8.407.530,00	1,06
USD ABU DHABI COMM BNK 5.5%/23-120129	3.000.000	2.983.200,00	0,38
USD ABU DHABI NATIONAL ENERG 4%/19-031049	2.000.000	1.549.820,00	0,20
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT 2.634%/21-170526	5.000.000	4.465.700,00	0,57
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BA 3.994%/19-21.09.2029	9.500.000	7.779.455,00	0,98
USD AIA GROUP LTD 3.375%/20-070430	3.500.000	3.072.440,00	0,39
USD AKCB FINANCE LTD 4.75%/18-09.10.2023	3.000.000	2.994.330,00	0,38
USD ALFA SAB 1.44A 6.875%/14-25.03.2044	1.500.000	1.365.795,00	0,17
USD ALIBABA GROUP HOLDING 2.7%/21-09.02.2041	12.000.000	7.214.760,00	0,91
USD ALIBABA GROUP HOLDING 3.6%/15-28.11.2024	6.000.000	5.845.620,00	0,74
USD ALIBABA GROUP HOLDING 4.4%/17-061257	5.500.000	3.806.495,00	0,48
USD ALPEK SA DE CV 3.25%/21-250231	7.000.000	5.501.090,00	0,70
USD ANGLGOLD HLDGS PLC 3.75%/20-01.10.2030	5.000.000	4.036.550,00	0,51
USD ANGLGOLD PLC 3.375%/21-011128	8.000.000	6.769.760,00	0,86
USD BAIDU INC 4.375%/18-14.05.2024	2.000.000	1.981.600,00	0,25
USD BANC CREDITO INVERSIONES 3.5%/17-121027	4.000.000	3.651.880,00	0,46
USD BANCO GENERAL SA 4.125%/17-07.08.2027	3.000.000	2.777.070,00	0,35
USD BANCO INBURSA 4.375%/17-11.04.2027	9.500.000	8.897.830,00	1,13
USD BANCO INTERNAC DEL PERU 3.25%/19-04.10.2026	9.000.000	8.297.100,00	1,05
USD BANCO SANTANDER CHILE 2.7%/20-100125	2.000.000	1.918.700,00	0,24
USD BANCO SANTANDER MEXICO 5.375%/20-17.04.2025	10.000.000	9.840.200,00	1,25
USD BANGKOK BANK PCL/HK 5.5%/23-210933	2.000.000	1.925.980,00	0,24
USD BANGKOK BANK PUBLIC FRN/22-150627	7.000.000	6.687.660,00	0,85
USD BANK LEUMI LE-ISRAEL 5.125%/22-270727	9.000.000	8.760.420,00	1,11
USD BANK RAKYAT INDONESIA 3.95%/19-28.03.2024	10.000.000	9.898.400,00	1,25
USD BEVA BANCOMER SA TEXAS 1.875%/20-18.09.2025	5.000.000	4.591.200,00	0,58
USD BEVA BANCOMER SA TEXAS 4.375%/14-10.04.2024	2.000.000	1.979.100,00	0,25
USD BERLIGALAXY S D 2.16%/21-310334N	2.000.000	1.482.911,84	0,19
USD BOC AVIATION LTD 3.25%/20-290425	3.500.000	3.348.730,00	0,42
USD BOC AVIATION LTD 3.5%/17-18.09.2027	2.000.000	1.844.900,00	0,23
USD BOC AVIATION LTD 3.5%/19-10.10.2024	8.000.000	7.787.760,00	0,99
USD BOC AVIATION LTD 4%/19-250124	1.000.000	993.125,00	0,13
USD BURL INTERNATIONAL SINGA 4.375%/17-18.01.2027	5.000.000	4.730.950,00	0,60
USD BRASKEM NETHERLANDS B.V. 4.5%/19-31.01.2030	2.500.000	2.036.450,00	0,26
USD CBO FINANCE LTD 2%/20-15.09.2025	7.500.000	6.925.350,00	0,88
USD CBO FINANCE LTD 2%/21-120526	8.000.000	7.240.080,00	0,92
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION 4.5%/14-01.08.2024	750.000	735.960,00	0,09
USD CENCOSUD SA 4.375%/17-17.07.2027	8.000.000	7.432.160,00	0,94
USD CERRO DEL AGUILA SA 4.125%/17-16.08.2027	5.500.000	5.051.310,00	0,64
USD CIMB BANK BHD 2.125%/22-200727	4.000.000	3.534.280,00	0,45
USD CK HUTCHISON INTL 19 LTD 3.25%/19-110424	2.000.000	1.973.080,00	0,25
USD CK HUTCHISON INTL 23 4.75%/23-210428	2.000.000	1.927.240,00	0,24
USD CK HUTCHISON INTL 23 4.875%/23-210433	8.000.000	7.457.840,00	0,94
USD COLBUN SA 3.15%/20-06.03.2030	5.500.000	4.596.615,00	0,58
USD DIB SUKUK LTD 1.959%/21-220626	3.000.000	2.734.620,00	0,35
USD DIB SUKUK LTD 2.95%/20-16.01.2026	7.000.000	6.600.230,00	0,84
USD DOHA FINANCE LIMITED 2.375%/21-310326	14.500.000	13.262.425,00	1,68
USD ECOPETROL 5.875%/14-28.05.2045	5.000.000	3.308.100,00	0,42
USD ECOPETROL SA 8.625%/23-190129	4.000.000	4.021.520,00	0,51
USD ECOPETROL SA 8.875%/23-130133	1.550.000	1.514.861,50	0,19
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK 3.516%/19-06.03.2024	3.000.000	2.964.150,00	0,38
USD EMIRATES NBD BANK PJSC 1.638%/21-13.01.2026	6.000.000	5.471.400,00	0,69
USD EMPRESA NACIONAL DE TELECOMUNICACIONES SA ENTEL (REG. -S-) 4.75%/14-01.08.2026	2.300.000	2.207.678,00	0,28
USD EMPRESAS PUBLIC MEDELLIN 4.25%/19-18.07.2029	3.000.000	2.416.020,00	0,31
USD EMPRESAS PUBLIC MEDELLIN 4.375%/20-15.02.2031	1.500.000	1.155.165,00	0,15
USD ENEL CHILE SA 4.875%/18-12.06.2028	4.000.000	3.807.720,00	0,48
USD ENN ENERGY HOLDINGS LTD 2.625%/20-170930	3.000.000	2.415.120,00	0,31
USD EXPORT-IMPORT BK THAIL 3.902%/22-020627	8.000.000	7.552.800,00	0,96
USD FENIX POWER PERU SA 4.317%/17-200927	4.000.000	2.466.165,18	0,31
USD FIRST ABU DHABI BK PJS 4.375%/23-240428	2.000.000	1.920.400,00	0,24
USD FRESNILLO PLC 4.25%/20-02.10.2050	7.000.000	4.913.020,00	0,62
USD GACI FIRST INVESTMENT 4.875%/23-140235	3.000.000	2.719.710,00	0,34
USD GACI FIRST INVESTMENT 5.125%/23-140253	2.000.000	1.627.360,00	0,21
USD GAS NATURAL LICUADO QUINTERO (REG. -S-) 4.634%/14-31.07.2029	10.000.000	6.747.312,60	0,85
USD GC TREASURY CENTRE CO 4.4%/22-300332	3.000.000	2.564.850,00	0,32
USD GC TREASURY CENTRE CO 5.2%/22-300352	2.000.000	1.507.440,00	0,19
USD GERDAU TRADE 4.875%/17-241027	4.000.000	3.843.920,00	0,49
USD GLP CHINA HOLDINGS LTD 2.95%/21-290326	1.500.000	929.310,00	0,12
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLD 5.125%/19-15.05.2024	10.000.000	9.926.000,00	1,26
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLD 6.125%/19-15.05.2029	9.000.000	8.771.040,00	1,11
USD GRENSAIF PIPELINES BID 6.129%/23-230238	8.250.000	8.098.117,50	1,03
USD GRUPO BIMBO REG S 3.875%/14-270624	2.000.000	1.971.560,00	0,25
USD GRUPO TELEVISIA 6.125%/15-300146	1.000.000	912.990,00	0,12
USD GRUPO TELEVISIA 6.625%/10-15.01.2040	1.000.000	975.120,00	0,12
USD GS CALTEX CORP 1.625%/20-27.07.2025	5.000.000	4.624.850,00	0,59

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

## Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund

## Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD GULF INTERNATIONAL BANK 2.375%/20-23.09.2025	12.000.000	11.165.880,00	1,41	USD TENCENT HOLDINGS LTD 3.595%/18-19.01.2028	1.000.000	916.040,00	0,12
USD GUSAP III LP 4.25%/19-21.01.2030	1.000.000	905.300,00	0,11	USD TENCENT HOLDINGS LTD 3.68%/21-220441	7.000.000	4.856.110,00	0,61
USD HANA BANK 3.25%/22-300327	4.150.000	3.850.826,50	0,49	USD TENCENT HOLDINGS LTD 3.975%/19-11.04.2029	6.000.000	5.448.420,00	0,69
USD HANRIJ OVERSEAS REG S 3%/16-140726	6.000.000	5.562.600,00	0,70	USD THAI OIL TREASURY CENTER COMPANY LTD 3.75%/20-18.06.2050	3.000.000	1.816.470,00	0,23
USD HIKMA FINANCE USA LLC 3.25%/20-09.07.2025	7.000.000	6.644.680,00	0,84	USD THAI OIL TRSRY CENTER 3.5%/19-17.10.2049	5.000.000	2.892.750,00	0,37
USD HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/21-221127	5.000.000	4.414.750,00	0,56	USD TRANS PERU (REG. -S-) 4.25%/13-30.04.2028	6.000.000	5.673.720,00	0,72
USD HUARONG FINANCE 2019 3.75%/19-29.05.2024	5.000.000	4.837.400,00	0,61	USD TRUST F/1401 4.869%/19-15.01.2030	9.000.000	7.620.300,00	0,96
USD HUARONG FINANCE 2019 4.5%/19-29.05.2029	6.000.000	4.796.280,00	0,61	USD UPL CORP LTD 4.625%/20-16.06.2030	3.000.000	2.424.420,00	0,31
USD INDOFOOD CBP SUKSES 4.805%/21-270452	4.000.000	2.787.640,00	0,35	USD US TREASURY N/B S BD-2024 3%/22-300624	4.500.000	4.418.925,39	0,56
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAK 3.398%/21-090631	2.000.000	1.611.960,00	0,20	USD US TREASURY N/B S. -Z-2025-0.25%/20-31.05.2025	5.000.000	4.610.937,50	0,58
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB D 4.15%/19-12.09.2029	10.000.000	8.805.400,00	1,11	USD US TREASURY S BD-2025 4.625%/23-300625	3.000.000	2.974.218,75	0,38
USD INTERCORP FIN SER INC 4.125%/17-19.10.2027	8.000.000	7.100.090,00	0,90	USD WIPRO IT SERVICE 1.5%/21-230626	3.000.000	2.683.620,00	0,34
USD INVERSIONES CMPC (REG. -S-) 4.75%/14-15.09.2024	1.000.000	985.990,00	0,12	<b>Total Anleihen</b>	<b>750.911.673,21</b>	<b>95,07</b>	
USD INVERSIONES CMPC SA 3.85%/20-13.01.2030	2.200.000	1.910.304,00	0,24	<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>	<b>750.911.673,21</b>	<b>95,07</b>	
USD KALLPA GENERACION (REG.-S-) 4.875%/16-24.05.2026	3.000.000	2.872.560,00	0,36	<b>Nicht börsennotierte Wertpapiere</b>			
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO 5.375%/18-24.04.2030	3.000.000	2.730.360,00	0,35	<b>Anleihen</b>			
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO 6.375%/18-24.10.2048	3.000.000	2.442.150,00	0,31	USD ABU DHABI BANK 5.375%/23-180728	3.000.000	2.973.900,00	0,38
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (REG. -S-) 5.75%/17-29.04.2047	6.000.000	4.672.740,00	0,59	USD BRASKEM NETHERLANDS 8.5%/23-120131	1.500.000	1.486.095,00	0,19
USD KEB HANA BANK 3.5%/19-300124	6.000.000	5.951.520,00	0,75	USD FIRST ABU DHABI BANK 4.774%/23-060628	10.000.000	9.754.500,00	1,24
USD LENOVO GROUP LTD 3.421%/20-02.11.2030	8.000.000	6.539.760,00	0,83	USD HDFC BANK LTD 5.686%/23-020326	2.000.000	2.000.360,00	0,25
USD LG CHEM LTD 1.375%/21-070726	4.000.000	3.555.200,00	0,45	USD KB KOOKMIN CARD CO LTD 4%/22-090625	5.000.000	4.831.000,00	0,61
USD LG CHEM LTD 4.375%/22-140725	4.850.000	4.715.752,00	0,60	USD PT BANK MANDIRI TBK 5.5%/23-040426	3.150.000	3.119.854,50	0,40
USD MAF SUKUK LTD S. -Z- 4.5%/15-03.11.2025	3.300.000	3.206.280,00	0,41	<b>Total Anleihen</b>	<b>24.165.709,50</b>	<b>3,06</b>	
USD MASHREOBANK PSC 4.25%/19-26.02.2024	5.000.000	4.955.650,00	0,63	<b>Nicht börsennotierte Wertpapiere</b>	<b>24.165.709,50</b>	<b>3,06</b>	
USD MDGH - GMTN BV 2.5%/19-07.11.2024	10.000.000	9.627.000,00	1,22	<b>Geldmarktinstrumente</b>			
USD MEGLOBAL CANADA INC 5%/20-18.05.2025	7.000.000	6.829.620,00	0,86	USD INDUSTRIAL BANK OF KOREA CP 050124	5.000.000	4.923.217,00	0,62
USD MEXICHEM (REG. -S-) 5.875%/14-17.09.2044	9.000.000	7.490.700,00	0,95	<b>Total Geldmarktinstrumente</b>	<b>4.923.217,00</b>	<b>0,62</b>	
USD MINERA Y METALURGIA DEL 3.25%/19-17.04.2024	4.450.000	4.380.446,50	0,55	<b>Total des Wertpapierbestandes</b>	<b>780.000.599,71</b>	<b>98,76</b>	
USD MINSUR SA 4.5%/21-281031	6.500.000	5.488.600,00	0,69	Bankguthaben und sonstige	5.763.679,00	0,73	
USD MISC CAPITAL TWO LABUAN 3.625%/22-060425	9.000.000	8.663.400,00	1,10	Andere Nettovermögenswerte	4.064.302,74	0,51	
USD MISC CAPITAL TWO LABUAN 3.75%/22-060427	5.000.000	4.625.000,00	0,59	<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>789.828.581,45</b>	<b>100,00</b>	
USD MIZUHO FINANCIAL FF FRN/23-060729	8.000.000	7.891.360,00	1,00				
USD NAKILAT INC 6.057%/06-31.12.93	5.000.000	4.378.669,36	0,55				
USD NATIONAL COMPANY KAZMUNAYGAY JSC 3.5%/20-14.04.2033	3.000.000	2.249.460,00	0,28				
USD NBK SPC LTD FF FRN/21-150927	6.000.000	5.329.980,00	0,67				
USD NEXA RESOURCES SA 5.375%/17-040527	5.000.000	462.895,00	0,06				
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.172%/21-140728	3.000.000	2.489.250,00	0,32				
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.648%/20-160125	2.000.000	1.909.180,00	0,24				
USD PERUSAHAAN GAS NEGARA (REG. -S-) 5.125%/14-16.05.2024	7.400.000	7.357.746,00	0,93				
USD POWER FINANCE CORP LTD 3.25%/19-16.09.2024	6.000.000	5.834.940,00	0,74				
USD POWER FINANCE CORP LTD 3.75%/19-18.06.2024	2.000.000	1.965.740,00	0,25				
USD POWER FINANCE S 2 5.25%/18-100828	3.000.000	2.894.580,00	0,37				
USD PROSUS N.V. 3.68%/20-121229	5.000.000	4.047.800,00	0,51				
USD PROSUS NV 3.061%/21-130731	8.000.000	5.964.240,00	0,76				
USD PROSUS NV 3.632%/20-08.02.2051	12.000.000	6.646.560,00	0,84				
USD PROSUS NV 4.027%/20-030850	3.000.000	1.723.770,00	0,22				
USD PT BANK MANDIRI (PERSERO) 2%/21-190426	5.000.000	4.538.950,00	0,57				
USD PT BANK MANDIRI (PERSERO) TBK 3.75%/19-11.04.2024	3.000.000	2.963.580,00	0,38				
USD PT BANK MANDIRI (PERSERO) TBK 4.75%/20-13.05.2025	5.000.000	4.908.050,00	0,62				
USD PT FREEPORT INDONESIA 4.763%/22-140427	3.000.000	2.853.750,00	0,36				
USD PTTEP TREASURY CENTER CO 3.903%/19-06.12.2059	2.000.000	1.304.180,00	0,17				
USD QATAR PETROLEUM 3.125%/21-120741	2.000.000	1.385.920,00	0,18				
USD QNB FINANCE LTD 1.375%/21-26.01.2026	7.000.000	6.340.530,00	0,80				
USD QNB FINANCE LTD 2.75%/20-12.02.2027	6.500.000	5.952.375,00	0,75				
USD QNB FINANCE LTD 3.5%/19-28.03.2024	10.000.000	9.867.800,00	1,25				
USD RAS LAFFAN LIQUEFIED NATURAL GAS (REG. -S-) S. -B- 5.838%/05-30.09.2027	5.000.000	3.779.530,59	0,48				
USD REC LTD 5.825%/23-110428	1.650.000	1.609.311,00	0,20				
USD RELIANCE INDUSTRIES 2.875%/22-120132	7.000.000	5.579.420,00	0,71				
USD RELIANCE INDUSTRIES 3.625%/22-120152	9.000.000	5.767.110,00	0,73				
USD RELIANCE INDUSTRIES 3.667%/17-301127	4.000.000	3.707.560,00	0,47				
USD SA GLOBAL SUKUK LTD 0.946%/21-170624	4.000.000	3.856.480,00	0,49				
USD SABIC CAPITAL II BV 4%/18-10.10.2023	5.000.000	4.993.750,00	0,63				
USD SAUDI ARABIAN OIL CO 1.25%/20-24.11.2023	1.150.000	1.141.904,00	0,14				
USD SAUDI ARABIAN OIL CO 3.5%/20-241170	4.000.000	2.364.320,00	0,30				
USD SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 2.875%/19-16.04.2024	13.000.000	12.774.580,00	1,62				
USD SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 4.25%/19-16.04.2039	10.000.000	8.138.700,00	1,03				
USD SAUDI ELEC GLB SUKUK 4.222%/18-27.01.2024	2.000.000	1.986.100,00	0,25				
USD SAUDI ELECTRICITY SUKUK 5.684%/23-110453	8.000.000	7.204.320,00	0,91				
USD SHINHAN CARD CO LTD 1.375%/20-191025	4.500.000	4.095.180,00	0,52				
USD SIGMA ALIMENTOS SA DE CV (REG. -S-) 4.125%/16-02.05.2026	5.000.000	4.750.450,00	0,60				
USD SK TELECOM CO LTD 6.625%/07-20.07.2027	8.000.000	8.288.960,00	1,05				
USD ST MARYS CEMENT INC 5.75%/16-280127	5.000.000	4.867.250,00	0,62				
USD STANDARD CHARTERED 197 FF FRN/22-120128	3.000.000	2.655.900,00	0,34				
USD STANDARD CHARTERED FF FRN/23-060734	4.000.000	3.863.760,00	0,49				
USD STANDARD CHARTERED FF FRN/23-090127	4.000.000	3.982.400,00	0,50				
USD STANDARD CHARTERED PLC FRN/21-290632	12.000.000	9.167.400,00	1,16				
USD SUMITOMO MITSUI FINL 5.808%/23-140933	3.000.000	2.916.300,00	0,37				
USD SURA ASSET MAN REG S 4.375%/17-110427	7.000.000	6.487.950,00	0,82				
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 5%/17-16.03.2047	1.000.000	962.710,00	0,12				
USD TELEFONICA CHILE 3.537%/21-181131	2.000.000	1.503.460,00	0,19				

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

## Technische Daten und Erläuterungen

### Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr
A - Ausschüttend	USD	43837410	LU1886375663	0,80%
B - Thesaurierend	USD	43838457	LU1886376802	0,80%
IA - Ausschüttend	USD	43856258	LU1886379061	0,50%
IA25 - Ausschüttend	USD	43856372	LU1886381471	0,35%
IB - Thesaurierend	USD	43856294	LU1886380150	0,50%
UA - Ausschüttend	USD	43857059	LU1886386272	0,60%
UB - Thesaurierend	USD	43857087	LU1886386942	0,60%
AH - Ausschüttend	AUD	43837443	LU1886376398	0,65%
BH - Thesaurierend	EUR	43839626	LU1886377529	0,60%
IBH - Thesaurierend	GBP	43856335	LU1886381125	0,50%
A - Ausschüttend	HKD	43837419	LU1886375820	0,65%
B - Thesaurierend	HKD	43838565	LU1886377016	0,65%
AH - Ausschüttend	SGD	43837441	LU1886376125	0,65%
BH - Thesaurierend	SGD	43838595	LU1886377289	0,65%

Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV wurde am 29.09.2023 geschlossen.

### Fondsperformance

		PTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	-0,52%	/	-6,29%	-6,71%	-0,46%
B - Thesaurierend	USD	-0,52%	/	-6,29%	-6,71%	-0,46%
IA - Ausschüttend	USD	-0,30%	/	-6,00%	-6,43%	-0,16%
IA25 - Ausschüttend	USD	-0,19%	/	-5,86%	-6,29%	-0,01%
IB - Thesaurierend	USD	-0,30%	/	-6,00%	-6,43%	-0,16%
UA - Ausschüttend	USD	-0,37%	/	-6,10%	-6,52%	-0,27%
UB - Thesaurierend	USD	-0,37%	/	-6,10%	-6,52%	-0,27%
AH - Ausschüttend	AUD	-1,57%	/	-6,93%	-6,86%	-1,09%
BH - Thesaurierend	EUR	-1,95%	/	-8,18%	-7,40%	-1,90%
IBH - Thesaurierend	GBP	-0,72%	/	-6,57%	-6,72%	-1,16%
A - Ausschüttend	HKD	-0,21%	/	-6,04%	-6,06%	-0,80%
B - Thesaurierend	HKD	-0,20%	/	-6,04%	-6,06%	-0,80%
AH - Ausschüttend	SGD	-1,40%	/	-6,39%	-6,59%	-0,79%
BH - Thesaurierend	SGD	-1,40%	/	-6,41%	-6,60%	-0,78%

PTD = Performance To Date (01.01.2023 – 29.09.2023)

### Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	02.11.2022	1,03
A - Ausschüttend	USD	07.02.2023	1,40
A - Ausschüttend	USD	02.05.2023	1,59
A - Ausschüttend	USD	01.08.2023	1,74
IA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	10,36
IA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	14,03
IA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	15,99
IA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	17,41
IA25 - Ausschüttend	USD	02.11.2022	10,36
IA25 - Ausschüttend	USD	07.02.2023	14,03
IA25 - Ausschüttend	USD	02.05.2023	15,99
IA25 - Ausschüttend	USD	01.08.2023	17,41
UA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	1,03
UA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	1,40
UA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	1,59
UA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	1,74
AH - Ausschüttend	AUD	02.11.2022	0,93
AH - Ausschüttend	AUD	07.02.2023	1,19
AH - Ausschüttend	AUD	02.05.2023	1,31
AH - Ausschüttend	AUD	01.08.2023	1,45
A - Ausschüttend	HKD	02.11.2022	7,30
A - Ausschüttend	HKD	07.02.2023	10,59
A - Ausschüttend	HKD	02.05.2023	9,06
A - Ausschüttend	HKD	01.08.2023	13,53
AH - Ausschüttend	SGD	02.11.2022	1,00
AH - Ausschüttend	SGD	07.02.2023	1,23
AH - Ausschüttend	SGD	02.05.2023	1,37
AH - Ausschüttend	SGD	01.08.2023	1,40

**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		<b>30.09.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Forderungen aus Verkauf von Wertpapieren		12.500.000,00*			
Zinsforderungen		564.739,77			
Andere Aktiva		965,50			
		<b>13.065.705,27</b>			
<b>Passiva</b>					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		12.814.213,94			
Andere Passiva		251.491,33			
		<b>13.065.705,27</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>0,00</b>			
<b>Teilfondsentwicklung</b>		<b>29.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>	<b>30.09.2021</b>	
<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>USD</b>	<b>429.647.388,20*</b>	<b>577.545.610,42</b>	<b>928.476.331,09</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A - Ausschüttend	USD	73,68	76,52	92,46	
B - Thesaurierend	USD	87,64	84,40	99,25	
IA - Ausschüttend	USD	747,98	773,92	932,21	
IA25 - Ausschüttend	USD	744,32	769,30	925,43	
IB - Thesaurierend	USD	888,71	853,23	1.000,44	
UA - Ausschüttend	USD	74,46	77,12	92,99	
UB - Thesaurierend	USD	88,45	85,00	99,77	
AH - Ausschüttend	AUD	73,27	76,39	92,44	
BH - Thesaurierend	EUR	80,79	79,62	94,93	
IBH - Thesaurierend	GBP	847,26	820,69	964,76	
A - Ausschüttend	HKD	758,57	771,29	920,64	
B - Thesaurierend	HKD	879,68	848,92	988,59	
AH - Ausschüttend	SGD	73,06	75,96	91,80	
BH - Thesaurierend	SGD	86,15	83,84	98,50	
* Letzter TNA vor Liquidation					
<b>Anzahl der Aktien im Umlauf</b>		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Aktien</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Aktien</b>
A - Ausschüttend	USD	0,000	1.366.097,880	0,000	1.366.097,880
B - Thesaurierend	USD	0,000	292.008,690	2.964,081	294.972,771
IA - Ausschüttend	USD	0,000	271.290,822	0,000	271.290,822
IA25 - Ausschüttend	USD	0,000	109.188,780	0,000	109.188,780
IB - Thesaurierend	USD	0,000	57.530,802	0,000	57.530,802
UA - Ausschüttend	USD	0,000	154.174,082	0,000	154.174,082
UB - Thesaurierend	USD	0,000	113.751,258	0,000	113.751,258
AH - Ausschüttend	AUD	0,000	161.150,047	0,000	161.150,047
BH - Thesaurierend	EUR	0,000	284.815,560	0,000	284.815,560
IBH - Thesaurierend	GBP	0,000	4.637,000	0,000	4.637,000
A - Ausschüttend	HKD	0,000	301.757,184	0,000	301.757,184
B - Thesaurierend	HKD	0,000	16.601,514	0,000	16.601,514
AH - Ausschüttend	SGD	0,000	313.742,040	0,000	313.742,040
BH - Thesaurierend	SGD	0,000	22.783,556	0,000	22.783,556

\* Diese Position betrifft die Anleihe BAIDU INC 3.875%/18-290923, die zum 29.09.2023 fällig wurde und deren Nennbetrag zum 10.10.2023 vereinnahmt wurde. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)**

	Für die Periode vom 01.10.2022 bis zum 29.09.2023 (Liquidationsdatum)*
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>577.545.610,42</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	19.735.017,79
Bankzinsen	246.875,71
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	593.302,99
	<b>20.575.196,49</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	2.743.148,10
Depotbank- und Depotgebühr	281.648,52
Verwaltungskosten	342.921,14
Druck- und Veröffentlichungskosten	50.519,13
Zinsen und Bankspesen	6.606,74
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	348.201,32
"Taxe d'abonnement"	189.782,59
	<b>3.962.827,54</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>16.612.368,95</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-168.409.971,49
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	6.445.942,99
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	1.418.767,79
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-1.427.971,23
	<b>-161.973.231,94</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-145.360.862,99</b>
<b>Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	172.728.598,61
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-5.795.285,00
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	1.965.853,34
	<b>168.899.166,95</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>23.538.303,96</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	243.232,72
Rücknahmen**	-572.400.118,31
	<b>-572.156.885,59</b>
<b>Ausschüttung</b>	<b>-28.927.028,79</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>0,00</b>

\* Die Laufzeit des Subfonds Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV endete am 29.09.2023.

\*\* Einschliesslich der letzten Rückzahlung des Betrags von 429.647.388,20 USD mit Valutadatum vom 29.09.2023. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.



## Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V

## Technische Daten und Erläuterungen

## Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	50415294	LU2062620526	0,70%	0,94%
B - Thesaurierend	USD	50415061	LU2062500892	0,70%	0,94%
DA - Ausschüttend	USD	50392431	LU2062502088	0,00%	/
IA - Ausschüttend	USD	50382656	LU2062503722	0,40%	0,64%
IB - Thesaurierend	USD	50382734	LU2062504704	0,40%	0,64%
IB25 - Thesaurierend	USD	50414440	LU2062506402	0,25%	0,49%
UA - Ausschüttend	USD	50427461	LU2062511311	0,50%	0,74%
UB - Thesaurierend	USD	50453244	LU2062512392	0,50%	0,74%
AH - Ausschüttend	AUD	50415057	LU2062500207	0,60%	0,92%
IBH - Thesaurierend	EUR	50382737	LU2062504886	0,30%	0,62%
IAH - Ausschüttend	GBP	50382693	LU2062504290	0,40%	0,72%
A - Ausschüttend	HKD	50415052	LU2062620872	0,60%	/
AH - Ausschüttend	SGD	50415059	LU2062500462	0,60%	0,92%

Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -DA- USD wurde am 28.11.2022 geschlossen.

Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V -A- HKD wurde am 09.12.2022 geschlossen.

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die DA-Aktienklasse.

## Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021
A - Ausschüttend	USD	-3,09%	-13,55%	-9,37%	-5,70%
B - Thesaurierend	USD	-3,09%	-13,55%	-9,37%	-5,70%
DA - Ausschüttend	USD	/	/	/	-4,95%
IA - Ausschüttend	USD	-2,87%	-12,58%	-9,10%	-5,41%
IB - Thesaurierend	USD	-2,87%	-12,58%	-9,10%	-5,41%
IB25 - Thesaurierend	USD	-2,76%	-12,08%	-8,96%	-5,27%
UA - Ausschüttend	USD	-2,95%	-12,91%	-9,19%	-5,51%
UB - Thesaurierend	USD	-2,95%	-12,91%	-9,19%	-5,51%
AH - Ausschüttend	AUD	-4,21%	-15,57%	-10,30%	-5,92%
IBH - Thesaurierend	EUR	-4,43%	-17,74%	-11,11%	-6,16%
IAH - Ausschüttend	GBP	-3,34%	-14,76%	-9,90%	-5,68%
A - Ausschüttend	HKD	/	/	/	-5,08%
AH - Ausschüttend	SGD	-4,06%	-14,10%	-9,62%	-5,64%

## Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	02.11.2022	0,75
A - Ausschüttend	USD	07.02.2023	0,75
A - Ausschüttend	USD	02.05.2023	0,75
A - Ausschüttend	USD	01.08.2023	0,75
DA - Ausschüttend	USD	04.11.2022	7,72
IA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	7,50
IA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	7,50
IA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	7,50
IA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	7,50
UA - Ausschüttend	USD	02.11.2022	0,75
UA - Ausschüttend	USD	07.02.2023	0,75
UA - Ausschüttend	USD	02.05.2023	0,75
UA - Ausschüttend	USD	01.08.2023	0,75
AH - Ausschüttend	AUD	02.11.2022	0,50
AH - Ausschüttend	AUD	07.02.2023	0,50
AH - Ausschüttend	AUD	02.05.2023	0,50
AH - Ausschüttend	AUD	01.08.2023	0,50
IAH - Ausschüttend	GBP	02.11.2022	5,00
IAH - Ausschüttend	GBP	07.02.2023	5,00
IAH - Ausschüttend	GBP	02.05.2023	5,00
IAH - Ausschüttend	GBP	01.08.2023	5,00
A - Ausschüttend	HKD	01.11.2022	7,50
AH - Ausschüttend	SGD	02.11.2022	0,70
AH - Ausschüttend	SGD	07.02.2023	0,70
AH - Ausschüttend	SGD	02.05.2023	0,70
AH - Ausschüttend	SGD	01.08.2023	0,70

**Technische Daten und Erläuterungen (Fortsetzung)****Erläuterungen****Devisentermingeschäfte**

<b>Käufe</b>		<b>Verkäufe</b>		<b>Fälligkeit</b>	<b>Bewertung</b> (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
GBP	590.200	USD	-735.598	10.10.2023	-15.152,20
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
SGD	386.300	USD	-283.447	10.10.2023	-292,74
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	426.221	EUR	-402.500	10.10.2023	-122,70
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.568.700	USD	-1.684.287	10.10.2023	-22.656,73
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
AUD	958.600	USD	-612.694	10.10.2023	6.215,23
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.560.500	USD	-1.665.974	24.10.2023	-12.042,38
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
SGD	384.200	USD	-281.317	24.10.2023	467,95
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
AUD	953.400	USD	-611.956	24.10.2023	3.882,96
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	588.800	USD	-725.098	24.10.2023	-6.298,98
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften</b>					<b>-45.999,59</b>

## Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V

**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		<b>30.09.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		168.454.521,22			
Bankguthaben und sonstige		290.349,08			
Forderungen aus Erträgen		1.358.171,97			
		<b>170.103.042,27</b>			
<b>Passiva</b>					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		37,53			
Rückstellungen für Aufwendungen		108.945,56			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		45.999,59			
		<b>154.982,68</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>169.948.059,59</b>			
<b>Teilfondsentwicklung</b>					
		<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>	<b>30.09.2021</b>	
<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>USD</b>	<b>169.948.059,59</b>	<b>268.043.286,78</b>	<b>457.282.796,77</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A - Ausschüttend	USD	77,00	78,14	97,92	
B - Thesaurierend	USD	86,45	84,46	102,25	
DA - Ausschüttend	USD	/	775,32	969,75	
IA - Ausschüttend	USD	779,20	788,04	984,36	
IB - Thesaurierend	USD	874,20	851,56	1.027,82	
IB25 - Thesaurierend	USD	879,16	855,11	1.030,56	
UA - Ausschüttend	USD	77,61	78,58	98,26	
UB - Thesaurierend	USD	87,09	84,92	102,60	
AH - Ausschüttend	AUD	77,70	79,28	98,65	
IBH - Thesaurierend	EUR	822,64	822,59	1.007,61	
IAH - Ausschüttend	GBP	789,80	797,81	988,45	
A - Ausschüttend	HKD	/	790,89	981,52	
AH - Ausschüttend	SGD	76,39	78,33	97,91	
<b>Anzahl der Aktien im Umlauf</b>					
		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Aktien</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Aktien</b>
A - Ausschüttend	USD	338.637,985	443.527,068	0,000	104.889,083
B - Thesaurierend	USD	92.551,208	124.340,364	0,000	31.789,156
DA - Ausschüttend	USD	0,000	9.996,103	0,000	9.996,103
IA - Ausschüttend	USD	104.578,749	146.068,097	9.838,214	51.327,562
IB - Thesaurierend	USD	13.747,835	22.057,406	0,000	8.309,571
IB25 - Thesaurierend	USD	33.411,293	59.911,293	0,000	26.500,000
UA - Ausschüttend	USD	31.685,543	55.279,379	0,000	23.593,836
UB - Thesaurierend	USD	51.073,321	112.757,118	0,000	61.683,797
AH - Ausschüttend	AUD	24.443,683	28.925,346	0,000	4.481,663
IBH - Thesaurierend	EUR	3.291,832	15.324,421	0,000	12.032,589
IAH - Ausschüttend	GBP	1.484,001	1.484,001	0,000	0,000
A - Ausschüttend	HKD	0,000	4.000,000	0,000	4.000,000
AH - Ausschüttend	SGD	10.017,000	10.017,000	0,000	0,000

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)**Für die Periode vom  
01.10.2022 bis zum  
30.09.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>268.043.286,78</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	8.690.484,82
Bankzinsen	56.623,40
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	402.762,21
	<b>9.149.870,43</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	965.926,53
Depotbank- und Depotgebühr	132.251,26
Verwaltungskosten	160.158,99
Druck- und Veröffentlichungskosten	30.276,75
Zinsen und Bankspesen	1.660,09
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	129.058,74
"Taxe d'abonnement"	111.799,20
	<b>1.531.131,56</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>7.618.738,87</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-13.905.371,88
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	971.760,14
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-336.516,41
	<b>-13.270.128,15</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-5.651.389,28</b>
<b>Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	15.695.984,16
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	521.455,75
	<b>16.217.439,91</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>10.566.050,63</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	7.729.789,44
Rücknahmen	-111.117.858,59
	<b>-103.388.069,15</b>
<b>Ausschüttung</b>	<b>-5.273.208,67</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>169.948.059,59</b>

**Aufstellung des Wertpapierbestandes**

**Geographische Aufteilung**

Kaimaninseln	20,20
Japan	17,12
Südkorea	13,05
Britische Jungfernseln	8,72
Vereinigte Staaten	8,61
Indien	6,99
Philippinen	3,82
Indonesien	3,38
China	2,79
Hongkong	2,73
Nigeria	2,32
Ägypten	2,14
Niederlande	1,93
Spanien	1,16
Bermudas	1,03
Irland	0,71
Malaysia	0,58
Vereinigte Arabische Emirate	0,58
Mexiko	0,53
Australien	0,38
Singapur	0,34
<b>Total</b>	<b>99,12</b>

**Wirtschaftliche Aufteilung**

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	35,00
Banken und andere Kreditinstitute	23,43
Energie- und Wasserversorgung	5,72
Verschiedene Handelsunternehmen	4,96
Supranationale Organisationen	4,45
Baustoffe und Bauindustrie	4,08
Elektronik und Halbleiter	3,68
Petroleum	3,65
Immobilien	2,83
Länder und Zentralregierungen	2,31
Einzelhandel und Warenhäuser	2,08
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	1,46
Versicherungsgesellschaften	1,45
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	1,44
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	1,01
Elektrische Geräte und Komponenten	0,58
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,58
Verkehr und Transport	0,40
Diverse Dienstleistungen	0,01
<b>Total</b>	<b>99,12</b>

**Aufstellung des Wertpapierbestandes**

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Anleihen</b>			
USD 7-ELEVEN INC 0.8%/21-10.02.2024	3.600.000	3.532.248,00	2,08
USD ABO FINANCE 3.125%/19-24.09.2024	3.100.000	3.007.744,00	1,77
USD AFRICA FINANCE (REG. -S-) 3.875%/17-13.04.2024	4.000.000	3.936.280,00	2,32
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BA 4.125%/17-20.06.2024	3.700.000	3.633.178,00	2,14
USD BANCO SANTANDER SA 3.892%/22-24.05.24	2.000.000	1.970.960,00	1,16
USD BANK OF BARODA/LONDON 3.875%/19-04.04.2024	3.490.000	3.450.388,50	2,03
USD BANK OF PHILIPPINE ISLAN 2.5%/19-10.09.2024	1.760.000	1.699.456,00	1,00
USD BANK RAKYAT INDONESIA 3.95%/19-28.03.2024	1.230.000	1.217.503,20	0,72
USD BAYER US FIN 3.375%/18-15.07.24	1.000.000	978.780,00	0,58
USD BHARTI AIRTEL INTERNATIONAL (REG. -S-) 5.35%/14-20.05.2024	3.300.000	3.266.140,00	1,93
USD BOC AVIATION USA CORP 1.625%/21-29.04.24	2.300.000	2.241.304,00	1,32
USD BOS FUNDING LTD 4%/19-18.09.2024	3.000.000	2.915.100,00	1,72
USD CANARA BANK LONDON 3.875%/19-28.03.2024	500.000	494.495,00	0,29
USD CENTRAL CHN 7.75%/20-24.05.24	1.200.000	52.356,00	0,03
USD CENTRAL CHN REAL EST 7.25%/23-28.04.25	600.000	23.928,60	0,01
USD CENTRAL CHN REAL EST 7.9%/23-07.11.25	2.780.000	109.448,60	0,06
USD CENTRAL CHN REAL ESTATE 7.25%/20-13.08.24	1.000.000	44.560,00	0,03
USD CENTRAL CHN REAL ESTATE 7.25%/20-16.07.2024	1.000.000	44.190,00	0,03
USD CHARMING LIGHT -S- 5%/14-03.09.2024	2.600.000	2.560.298,00	1,51
USD CHINA GREAT WALL INTL IV 3.125%/19-31.07.24	1.800.000	1.717.614,00	1,01
USD CHINA SCE GRP HLDGS LTD 5.95%/21-29.09.24	3.470.000	180.509,40	0,11
USD CHINA SCE GRP HLDGS LTD 7.375%/19-09.04.2024	1.400.000	104.202,00	0,06
USD CHONGQING NANAN CON DEV 4.66%/19-04.06.2024	610.000	597.775,60	0,35
USD CIFI HOLDINGS GROUP 6.55%/19-28.03.2024	3.600.000	255.024,00	0,15
USD CK PROPERTY FINANCE S 9 0.75%/21-30.06.24	1.000.000	962.240,00	0,57
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD S. -14- 1.733%/19-10.09.2024	600.000	578.964,00	0,34
USD COUNTRY GARDEN HLDGS 6.5%/19-08.04.2024	2.500.000	177.025,00	0,10
USD CO INTL LOGISTICS HUB 4.3%/19-26.09.24	2.000.000	1.888.980,00	1,11
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK 3.516%/19-06.03.2024	1.000.000	988.050,00	0,58
USD EXPMP BANK KOREA 4%/22-15.09.24	4.270.000	4.200.484,40	2,47
USD FAB SUKUK CO LTD 3.875%/19-22.01.2024	2.150.000	2.133.294,50	1,26
USD FAR EAST HORIZON S 28 2.625%/21-03.03.24	3.500.000	3.409.175,00	2,01
USD FWD 5%/14-24.09.2024	2.500.000	2.461.100,00	1,45
USD GEMDALE EVER PROSPERITY 4.95%/21-12.08.24	2.800.000	1.231.804,00	0,72
USD GENERAL MOTORS FIN 3.95%/17-13.04.24	1.000.000	987.490,00	0,58
USD GOLDMAN SACHS 3%/22-15.03.24	1.000.000	986.710,00	0,58
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC FF FRN/21-10.09.24	1.000.000	998.170,00	0,59
USD GOODMAN HK FINANCE S. -1- 4.375%/14-19.06.2024	4.600.000	4.531.276,00	2,67
USD GS CALTEX CORP 3%/19-04.06.2024	3.850.000	3.770.305,00	2,22
USD HAITONG INTL SECURITIES 3.375%/19-19.07.24	800.000	777.496,00	0,46
USD INDIAN RAILWAY FINANCE 3.73%/19-29.03.24	600.000	593.250,00	0,35
USD INDUSTRIAL BK OF KOREA 0.625%/21-17.09.24	4.000.000	3.810.600,00	2,24
USD INVENTIVE GLOBAL 1.1%/21-01.09.24	1.000.000	956.720,00	0,56
USD JOHNSON ELECTRIC HOLDING 4.125%/30.07.24	1.000.000	981.400,00	0,58
USD KANSAI ELECTRIC POWER CO 2.55%/19-17.09.2024	5.798.000	5.599.012,64	3,29
USD KOREA ELECTRIC POWER CO 2.5%/19-24.06.2024	2.420.000	2.361.799,00	1,39
USD KOREA INV & SECS CO LTD 1.375%/21-19.07.24	880.000	843.559,20	0,50
USD KWG GROUP HOLDINGS 7.4%/19-05.03.2024	1.600.000	146.592,00	0,09
USD LOGAN PROPERTY HOLDINGS 5.25%/17-23.02.2023	1.500.000	107.130,00	0,06
USD LS FINANCE 2017 LTD 4.875%/19-15.07.24	3.500.000	3.267.355,00	1,92
USD MARUBENI CORP 3.56%/19-26.04.24	3.110.000	3.064.905,00	1,80
USD MINERA Y METALURGICA DEL 3.25%/19-17.04.2024	920.000	905.620,40	0,53
USD MIRAE ASSET DAEWOO CO 3.375%/19-07.05.2024	2.500.000	2.453.375,00	1,44
USD MITSUBISHI CORP 2.5%/19-09.07.24	1.000.000	973.890,00	0,57
USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.801%/18.07.24	800.000	780.456,00	0,46
USD NAN FUNG TREASURY 4.875%/14-29.05.24	200.000	197.590,00	0,12
USD NTT FINANCE CORP 0.563%/21-01.03.24	1.600.000	1.564.704,00	0,92
USD NTT FINANCE CORP 4.142%/22-26.07.24	2.800.000	2.760.744,00	1,62
USD PANASONIC CORP 2.679%/19-19.07.24	3.500.000	3.408.755,00	2,01
USD PHILIPPINE NATIONAL BANK 3.28%/19-27.09.2024	2.390.000	2.321.622,10	1,37
USD POWER FINANCE CORP LTD 3.25%/19-16.09.2024	800.000	777.992,00	0,46
USD POWER FINANCE CORP LTD 3.75%/19-18.06.2024	2.680.000	2.634.091,60	1,55
USD PT BANK MANDIRI (PERSERO) TBK 3.75%/19-11.04.2024	3.580.000	3.536.538,80	2,08
USD QIB SENIOR SUKUK LTD 4.264%/19-05.03.2024	3.800.000	3.766.408,00	2,22
USD QNB FINANCE LTD 3.5%/19-28.03.2024	3.900.000	3.848.442,00	2,26
USD REC LIMITED 3.375%/19-25.07.2024	1.800.000	1.759.752,00	1,04
USD RHB BANK 3.766%/19-19.02.24	1.000.000	991.580,00	0,58
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING 3%/19-11.09.2024	2.550.000	2.469.930,00	1,45
USD RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6.7%/19-30.09.24	3.300.000	2.250.270,00	1,32
USD SA GLOBAL SUKUK LTD 0.946%/21-17.06.24	1.500.000	1.446.180,00	0,85
USD SAKA ENERGI INDONESIA PT 4.45%/17-05.05.24	1.010.000	993.547,10	0,58
USD SEAZEN GROUP LTD 6%/20-12.08.2024	2.700.000	1.449.711,00	0,85

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

## Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V

## Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD SHIMAO PROPERTY HLDGS 6.125%/19-21.02.2024	3.200.000	137.696,00	0,08
USD SHOU GANG GROUP CO LTD 4%/19-23.05.2024	1.600.000	1.577.392,00	0,93
USD SHRIRAM TRANSPORT FIN 4.4%/21-13.03.2024	2.000.000	1.972.480,00	1,16
USD SHUI ON DEVELOPMENT HLDG 6.15%/20-24.08.2024	3.800.000	2.442.564,00	1,44
USD SINO OCEAN LAND TRADE FINANCE I 6%/14-30.07.2024	2.000.000	85.800,00	0,05
USD SK BATTERY AMERICA INC 1.625%/21-260124	1.000.000	983.630,00	0,58
USD SK HYNIX INC 1%/21-19.01.2024	2.400.000	2.362.344,00	1,39
USD SK HYNIX INC 3%/19-170924	500.000	494.500,00	0,29
USD SMBC AVIATION CAPITAL FI 3.55%/19-15.04.2024	1.230.000	1.212.915,30	0,71
USD STATE BANK INDIA/LON 4.375%/19-240124	200.000	198.958,00	0,12
USD SUHYUP BANK 3.625%/19-29.01.2024	1.900.000	1.885.313,00	1,11
USD SUMITOMO CORP 2.6%/19-090724	200.000	194.688,00	0,11
USD SUMITOMO MITSUI FIN GRP 2.448%/19-270924	2.300.000	2.221.662,00	1,31
USD SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.696%/160724	2.000.000	1.948.960,00	1,15
USD SUMITOMO MITSUI TR BK LT 0.8%/21-160924	2.500.000	2.379.475,00	1,40
USD SUNCORP-METWAY LTD 3.3%/19-15.04.2024	655.000	644.762,35	0,38
USD SWIRE PACIFIC MTN FIN 3%/17-05.07.2024	1.400.000	1.369.830,00	0,81
USD THE LINK FINANCE CAYMAN 3.6%/14-030924	2.500.000	2.448.050,00	1,44
USD TIMES CHINA HLDG LTD 5.55%/21-040624	2.600.000	100.932,00	0,06
USD TIMES CHINA HLDG LTD 6.6%/17-02.03.2023	400.000	15.652,00	0,01
USD TIMES CHINA HLDG LTD 6.75%/19-16.07.2023	500.000	19.140,00	0,01
USD TOYOTA TSUSHO CORP 2.596%/19-19.09.2024	4.330.000	4.193.691,60	2,47
USD US S. -J-2024- 2.125%/17-31.03.2024	2.130.000	2.095.595,52	1,23
USD US S. -T-2023- 2.25%/16-31.12.2023	600.000	595.382,81	0,35
USD US TREASURY N/B S. -AD-2024- 1.5%/19-30.09.2024	1.280.000	1.231.525,00	0,72
USD VERTEX CAPITAL INV LTD 4.75%/19-03.04.2024	500.000	493.960,00	0,29
USD VIGOROUS CHAMP INTL LTD 3.625%/19-280524	800.000	784.248,00	0,46
USD WUHAN METRO S 1 2.96%/19-240924	700.000	678.580,00	0,40
USD XI YANG OVERSEAS 4.3%/19-05.06.2024	800.000	789.856,00	0,46
USD XINGSHENG BVI CO LTD 1.375%/21-250824	1.800.000	1.723.572,00	1,01
USD ZHENRO PROPERTIES GROUP 7.1%/21-100924	2.100.000	21.798,00	0,01
<b>Total Anleihen</b>		<b>168.454.521,22</b>	<b>99,12</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>		<b>168.454.521,22</b>	<b>99,12</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>168.454.521,22</b>	<b>99,12</b>
Bankguthaben und sonstige		290.349,08	0,17
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-37,53	0,00
Andere Nettovermögenswerte		1.203.226,82	0,71
<b>Teilfondsvermögen</b>		<b>169.948.059,59</b>	<b>100,00</b>

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/corporate/docs/about-us/governance/compensation/compensation\\_policy.pdf](https://www.credit-suisse.com/media/assets/corporate/docs/about-us/governance/compensation/compensation_policy.pdf)) gelesen werden, die ausführlich über die Grundsätze der Vergütungspolitik informiert.

**Gesamtvergütung OGAW**

Zum 31. Dezember 2022 verwaltete Credit Suisse Fund Management S.A., im Folgenden "CSFM", Vermögenswerte im Gesamtwert von CHF 49,1 Mia., von denen CHF 39,8 Mia. in OGAW angelegt waren. Die im Folgenden dargelegten Daten zur Bruttogesamtvergütung entsprechen den in Bezug auf die Wertentwicklung 2022 gezahlten Beträgen.

**Mitarbeitervergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022:**

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 entrichtet von CSFM an 35 Empfänger	CHF 3.929.524,40, bestehend aus: - CHF 3.564.241,25 feste Vergütung - CHF 365.283,15 variable Vergütung
<i>Umfasst:</i>	
Vergütung der Geschäftsleitung	CHF 1.015.721,19
Vergütung von Kontrollfunktionen	CHF 539.740,14
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 30. September 2023 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 Verwaltungsrats honoraren, 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 30. September 2023:**

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 30. September 2023, die vom OGAW an Vertreter (Tätigkeiten des Portfoliomanagements und des Risikomanagements) gezahlt wurde.	CHF 4.147.528,04 Bestehend aus: - CHF 4.147.528,04 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 2022 wurden keine wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik vorgenommen.

**Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")****- Arten von SFT**

Per 30.09.2023 war die Gesellschaft an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

**- Wiederverwendung von Sicherheiten**

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

## Ungeprüfte Informationen

### - 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 30.09.2023 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) Emerging Market Corporate Bond Fund	USD	18,67	18,26
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V	USD	0,00	0,00

\* 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	Gesamtes Volumen der erhaltenen Sicherungswertpapiere und Rohstoffe pro Emittent auf Sammelkontoebene (in CHF)
FRANCE (GOVT OF)	93.177.860,71
EUROPEAN UNION	87.522.931,00
US TREASURY	80.047.362,28
NETHERLANDS GOVERNMENT	76.924.484,93
BELGIUM KINGDOM	72.182.281,54
REPUBLIC OF AUSTRIA	72.063.141,30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	51.081.337,57
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	48.920.724,60
NVIDIA CORP	46.539.717,93
NOVARTIS AG-REG	39.857.580,59

## Prozentsatz der Sicherheiten auf dem Sicherheitsammelkonto, die von den jeweiligen Subfonds gehalten werden

Subfonds	
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund	6,48%
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund	0,00%
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V	0,00%
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)	0,00%



**Restlaufzeit der Sicherheit im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften**

Subfonds	Währung	Fälligkeit der Sicherheit						
		Weniger als 1 Tag	Von 1 Tag bis 1 Woche	Von 1 Woche bis 1 Monat	Von 1 Monat bis 3 Monate	Von 3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Bond Fund	USD	0,00	0,00	690.216,02	2.418.479,35	5.616.349,57	42.112.818,34	25.681.535,51
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity FR Bond Fund 2023 S-IV (bis zum 29.09.2023)	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

**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 (ungeprüft)

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) Emerging Market Corporate Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900CW6400BENYNL06

## 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 8,33% an nachhaltigen Investitionen

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

with an environmental objective 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?

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 Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 5% ihres Umsatzes mit Öl und Gas aus der Arktis oder 10% ihres Umsatzes mit Ölsanden 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 Aktionärs-tum)

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 Aktionärs-tum 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 30.09.2023. 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 2,12%, AA: 17,21%, A: 16,68%, BBB: 28,59%, BB: 13,64%, B: 1,85%, CCC: 0,83%, Nicht bewertbar**: 2,27%, Keine Datenabdeckung**: 16,83%,	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	4,95	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,31	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	4,77	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 45,97%, Gelb: 21,77%, Orange: 7,59%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,06%, Keine Datenabdeckung**: 18,62%,	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: 21,85%, Neutral: 66,35%, Negativ: 3,13%, Keine Datenabdeckung**: 3,96%, Nicht bewertbar**: 4,71%	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?**

Ein Vergleich der Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren des Portfolios mit den vorherigen Zeiträumen wird ab dem kommenden Bezugszeitraum zur Verfügung stehen.

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

Obwohl dieser Subfonds keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen anstrebte, trugen die nachhaltigen Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums zum Erreichen eines 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, CO<sub>2</sub>- 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 CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7 % über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen, bei denen insgesamt mindestens 50 % ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen stammten, die zu einem ökologischen oder sozialen Ziel beitrugen (die Investitionen wurden dem jeweiligen Ziel zugewiesen, das den höheren Anteil vom Umsatz beisteuerte).

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 Group genehmigt.

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

Dieser Subfonds strebte keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen an. 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 mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten 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 Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.10.2022 bis zum 30.09.2023 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b><i>Treibhausgasemissionen</i></b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	80'025,79	90,43	70,26
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	14'930,74	90,43	70,26
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	496'266,25	90,43	70,03
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	590'451,22	90,43	69,89
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	1'122,77	90,43	69,89
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	1'809,67	90,43	73,80
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	22,49	90,43	73,47
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	49,93	90,43	57,78
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,43	61,61
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,19	90,43	61,61
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,25	90,43	61,61
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,17	90,43	61,61
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,43	61,61
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	90,43	61,61
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,04	90,43	61,61
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,43	61,61
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	90,43	61,61
<b><i>Biodiversität</i></b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,06	90,43	73,60
<b><i>Wasser</i></b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	92,76	90,43	2,01
<b><i>Abfall</i></b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	696,24	90,43	28,66
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b><i>Soziales und Beschäftigung</i></b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,22	90,43	73,62
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)	33,57	90,43	73,33

12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	0,92	90,43	5,00
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	13,40	90,43	73,49
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	90,43	73,62
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	50,82	8,67	5,60
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0,00	8,67	5,05
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	8,67	5,05
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
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:

30.09.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
TREASURY BILL	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,45	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED OVERSEAS BK LTD / 3,86% / 07.10.2032	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,54	Singapur
TENCENT HOLDINGS LTD / 3,98% / 11.04.2029	J. Information und Kommunikation	1,28	China
DIB SUKUK LTD / 2,95% / 16.01.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,19	Vereinigte Arabische Emirate
CBQ FINANCE LTD / 2,00% / 15.09.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,16	Katar
SHINHAN BANK / 4,38% / 13.04.2032	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,12	Korea, Republik
LG CHEM LTD / 4,38% / 14.07.2025	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,11	Korea, Republik
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC / 3,50% / 31.03.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,06	Vereinigte Arabische Emirate
SAUDI ARABIAN OIL CO / 3,50% / 16.04.2029	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,04	Saudi-Arabien
STATE BANK OF INDIA (LONDON BRANCH) / 2,49% / 26.01.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,03	Indien
ENN ENERGY HOLDINGS LTD / 2,63% / 17.09.2030	D. Energieversorgung	1,01	Hongkong
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT / 3,75% / 11.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,01	Indonesien
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC FXD-FXD / 3,15% / 16.07.2030	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,97	Japan
NK KAZMUNAYGAZ AO / 4,75% / 19.04.2027	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,96	Kasachstan
EXIM BANK / 3,90% / 02.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,96	Thailand

\* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 30.09.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

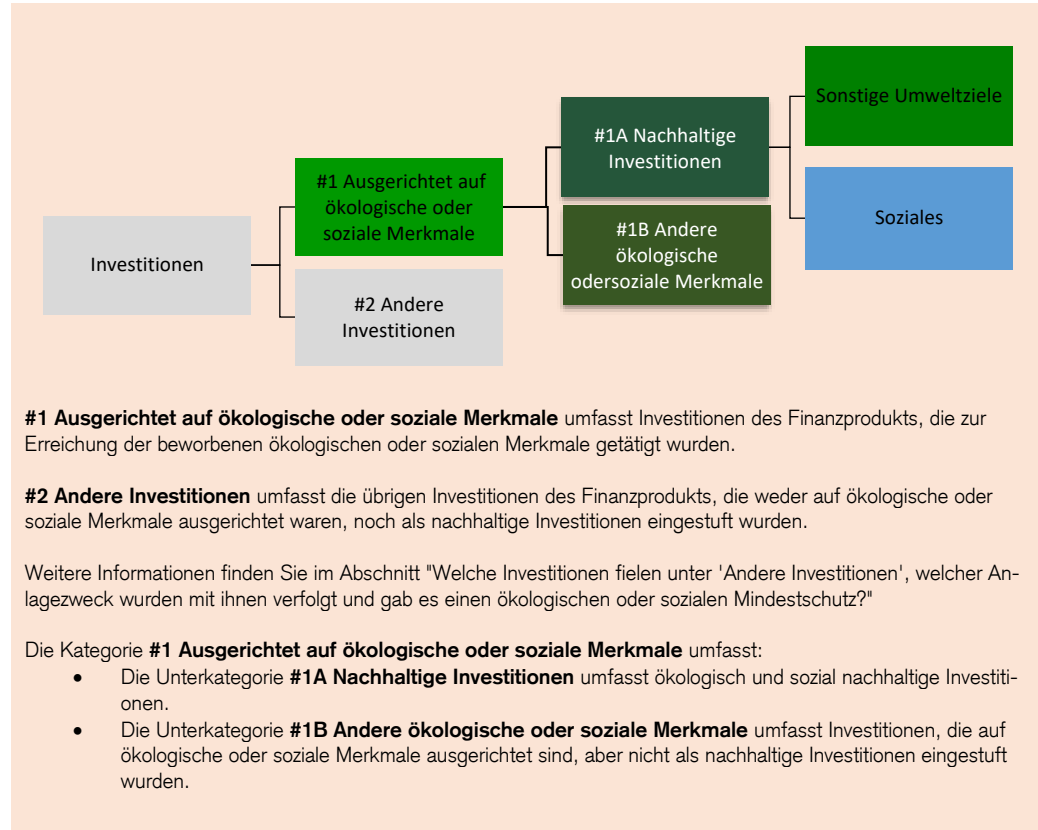




## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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 91,67% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 8,33% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 83,34% seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 8,33% seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 30.09.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

#### Subfondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,54%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	14,81%
C. Verarbeitendes Gewerbe	8,50%
D. Energieversorgung	3,66%
F. Baugewerbe	0,23%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,10%
H. Verkehr und Lagerei	1,74%
J. Information und Kommunikation	7,76%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	50,89%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	0,25%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,04%

N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,78%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,80%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,71%
Andere	4,20%

\* 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 30.09.2023. 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	9,61%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,42%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	3,69%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	1,01%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	0,02%

\* 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 30.09.2023. 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 CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin,



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

Zum 30.09.2023 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 sind<sup>1</sup>?**

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> 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.

dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

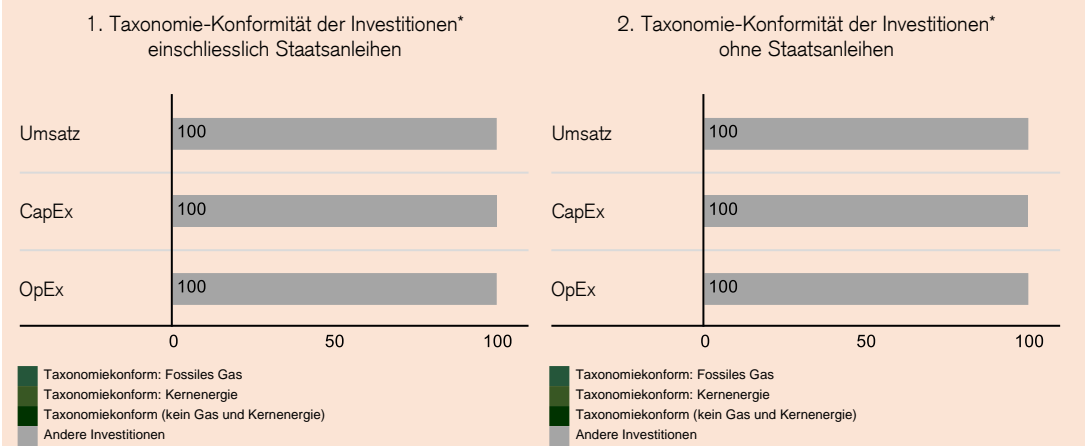
**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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 der 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 30.09.2023 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?**

Ein Vergleich der Investitionen des Portfolios, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, mit den vorherigen Zeiträumen wird ab dem kommenden Bezugszeitraum zur Verfügung stehen.



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

Zum 30.09.2023 waren 7,80% 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 30.09.2023 waren 0,53% 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 30.09.2023 waren 8,33% 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 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 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](http://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

**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) Emerging Market Corporate Investment Grade Bond Fund

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 529900PTOUHXEPD0CP85

## 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 <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 8,12% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> with an environmental objective in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> 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 Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 5% ihres Umsatzes mit Öl und Gas aus der Arktis oder 10% ihres Umsatzes mit Ölsanden 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 30.09.2023. 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 1,46%, AA: 16,05%, A: 16,94%, BBB: 32,16%, BB: 17,71%, B: 2,73%, CCC: 3,46%, Nicht bewertbar**: 0,28%, Keine Datenabdeckung**: 9,20%	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	4,86	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,22	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	4,54	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 53,68%, Gelb: 27,06%, Orange: 6,86%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 2,42%, Keine Datenabdeckung**: 9,98%	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: 18,68%, Neutral: 70,96%, Negativ: 6,63%, Keine Datenabdeckung**: 2,82%, Nicht bewertbar**: 0,90%	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?**

Ein Vergleich der Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren des Portfolios mit den vorherigen Zeiträumen wird ab dem kommenden Bezugszeitraum zur Verfügung stehen.

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

Obwohl dieser Subfonds keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen anstrebte, trugen die nachhaltigen Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums zum Erreichen eines 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, CO<sub>2</sub>- 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 CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen, bei denen insgesamt mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen stammten, die zu einem ökologischen oder sozialen Ziel beitrugen (die Investitionen wurden dem jeweiligen Ziel zugewiesen, das den höheren Anteil vom Umsatz beisteuerte).

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 Group genehmigt.

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

Dieser Subfonds strebte keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen an. 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 mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten 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 Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.10.2022 bis zum 30.09.2023 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b><i>Treibhausgasemissionen</i></b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	75'756,36	86,02	73,14
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	19'031,62	86,02	73,14
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	436'603,95	86,02	73,14
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	532'646,03	86,02	73,14
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	633,73	86,02	73,14
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	1'243,83	86,02	77,95
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	19,18	86,02	78,09
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	50,24	86,02	56,96
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,02	61,79
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,12	86,02	61,79
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,29	86,02	61,79
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,15	86,02	61,79
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,02	61,79
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,02	61,79
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,02	61,79
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	86,02	61,79
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,02	61,79
<b><i>Biodiversität</i></b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,03	86,02	78,09
<b><i>Wasser</i></b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	2,69	86,02	1,53
<b><i>Abfall</i></b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,51	86,02	25,35
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b><i>Soziales und Beschäftigung</i></b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	86,02	77,89
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)	36,12	86,02	78,01

12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	0,77	86,02	6,71
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	13,63	86,02	77,85
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	86,02	78,13
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	48,56	12,78	5,90
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0,00	12,78	5,71
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	12,78	5,71
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
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:

30.09.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
DOHA FINANCE LTD / 2,38% / 31.03.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,68	Katar
SAUDI ARABIAN OIL CO / 2,88% / 16.04.2024	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,64	Saudi-Arabien
GULF INTERNATIONAL BANK BSC / 2,38% / 23.09.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,41	Saudi-Arabien
GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS (BVI) LTD / 5,13% / 15.05.2024	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,28	Südafrika
BANCO SANTANDER MEXICO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE / 5,38% / 17.04.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,28	Spanien
BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO) 3,95% / 28.03.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,26	Indonesien
FIRST ABU DHABI BANK PJSC / 4,77% / 06.06.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,25	Vereinigte Arabische Emirate
QNB FINANCE LTD / 3,50% / 28.03.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,25	Katar
MAMOURA DIVERSIFIED GLOBAL HOLDING PJSC / 2,50% / 07.11.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,23	Vereinigte Arabische Emirate
STANDARD CHARTERED PLC / 2,68% / 29.06.2032	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,17	Vereinigtes Königreich
BANCO INBURSA SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FINANCIERO / 4,38% / 11.04.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,15	Mexiko
GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS (BVI) LTD / 6,13% / 15.05.2029	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,13	Südafrika
MISC CAPITAL TWO (LABUAN) LTD / 3,62% / 06.04.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,12	Malaysia
BANK LEUMI LE ISRAEL BM / 5,13% / 27.07.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,12	Israel
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV / 4,15% / 12.09.2029	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,11	Mexiko

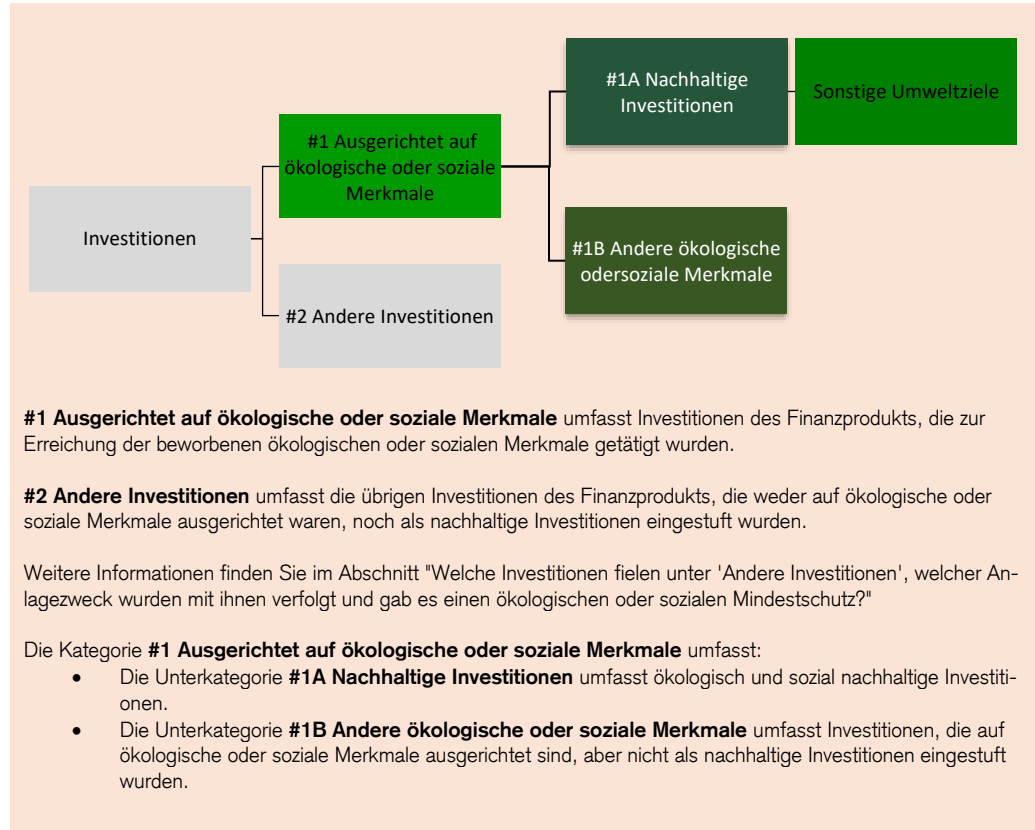
\* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 30.09.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



## 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 95,73% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 8,12% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 87,60% seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 4,27% seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 30.09.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

#### Subfondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	13,54%
C. Verarbeitendes Gewerbe	12,61%
D. Energieversorgung	3,36%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,10%
H. Verkehr und Lagerei	3,18%
J. Information und Kommunikation	6,16%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	51,97%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,61%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,73%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,53%
Andere	1,22%

\* 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 30.09.2023. 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	6,54%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	1,39%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	3,57%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,31%
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 30.09.2023. 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 CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin,



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

Zum 30.09.2023 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 sind<sup>1</sup>?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> 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.

dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

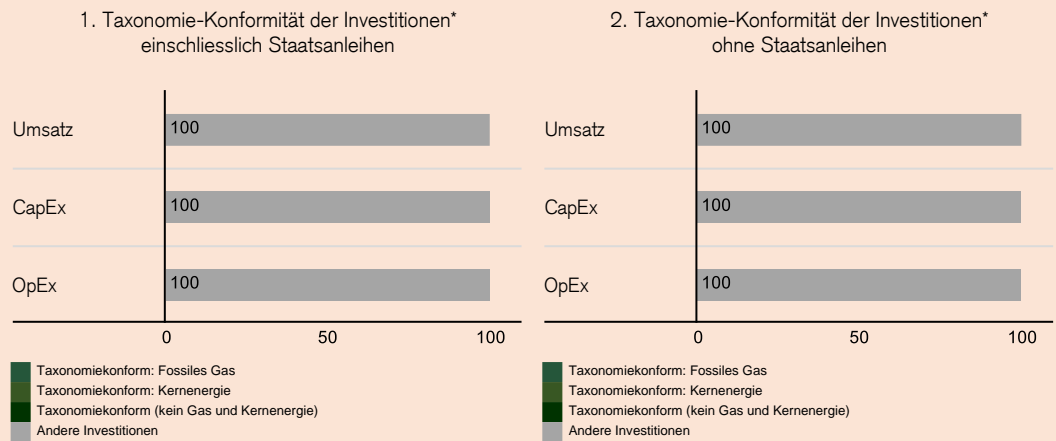
**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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 der 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 30.09.2023 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?**

Ein Vergleich der Investitionen des Portfolios, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, mit den vorherigen Zeiträumen wird ab dem kommenden Bezugszeitraum zur Verfügung stehen.





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

Zum 30.09.2023 waren 8,12% 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 30.09.2023 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 30.09.2023 waren 4,27% 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 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 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](http://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 (ungeprüft)

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) Fixed Maturity Bond Fund 2024 S-V

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493005X07PXM24HWQ70

## 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 5,87% an nachhaltigen Investitionen

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

with an environmental objective 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?

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 Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 5% ihres Umsatzes mit Öl und Gas aus der Arktis oder 10% ihres Umsatzes mit Ölsanden 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 30.09.2023. 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 3,04%, AA: 10,32%, A: 26,46%, BBB: 15,97%, BB: 19,05%, B: 5,64%, CCC: 4,00%, Nicht bewertbar**: -0,03%, Keine Datenabdeckung**: 15,55%	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	4,88	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,10	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	4,77	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 47,93%, Gelb: 23,67%, Orange: 7,65%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,66%, Keine Datenabdeckung**: 16,09%,	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: 17,51%, Neutral: 66,53%, Negativ: 9,64%, Keine Datenabdeckung**: 6,35%, Nicht bewertbar**:-0,03%	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?**

Ein Vergleich der Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren des Portfolios mit den vorherigen Zeiträumen wird ab dem kommenden Bezugszeitraum zur Verfügung stehen.

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

Obwohl dieser Subfonds keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen anstrebte, trugen die nachhaltigen Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums zum Erreichen eines 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, CO<sub>2</sub>- 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, bei denen insgesamt mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen stammten, die zu einem ökologischen oder sozialen Ziel beitrugen (die Investitionen wurden dem jeweiligen Ziel zugewiesen, das den höheren Anteil vom Umsatz beisteuerte).

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 Group genehmigt.

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

Dieser Subfonds strebte keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen an. 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 mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten 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 Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.10.2022 bis zum 30.09.2023 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](http://www.credit-suisse.com/esg).

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b><i>Treibhausgasemissionen</i></b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	11'527,10	89,51	71,05
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1'623,20	89,51	71,05
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	63'058,91	89,51	70,96
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	76'699,32	89,51	70,70
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	378,36	89,51	70,70
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	839,18	89,51	77,47
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	14,91	89,51	76,55
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	48,90	89,51	53,98
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	89,51	57,70
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	89,51	57,70
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,04	89,51	57,70
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,14	89,51	57,70
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	89,51	57,70
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	89,51	57,70
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	89,51	57,70
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	89,51	57,70
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	89,51	57,70
<b><i>Biodiversität</i></b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,53	89,51	76,55
<b><i>Wasser</i></b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,58	89,51	4,39
<b><i>Abfall</i></b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,10	89,51	16,87
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b><i>Soziales und Beschäftigung</i></b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	89,51	76,53
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)	48,07	89,51	76,41



12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	1,20	89,51	6,08
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	11,55	89,51	72,72
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	89,51	76,55
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	27,94	10,22	3,25
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0,00	10,22	2,78
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	10,22	2,78
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
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:

30.09.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
KANSAI ELECTRIC POWER CO / 2,55% / 17.09.2024	D. Energieversorgung	3,31	Japan
GOODMAN HK FINANCE / 4,38% / 19.06.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,71	Cayman-Inseln
BANK OF AMERICA CORP / 4,00% / 15.09.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,48	Korea, Republik
TOYOTA TSHUSHO CORP / 2,60% / 19.09.2024	G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,48	Japan
AFRICA FINANCE CORP / 3,88% / 13.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,36	Afrika, supranational
QNB FINANCE LTD / 3,50% / 28.03.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,27	Katar
INDUSTRIAL BK OF KOR / 0,63% / 17.09.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,25	Korea, Republik
GS CALTEX CORP / 3,00% / 04.06.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,25	Korea, Republik
QIIB SENIOR SUKUK LTD / 4,26% / 05.03.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,23	Katar
AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK / 4,13% / 20.06.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,17	Afrika, supranational
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT / 3,75% / 11.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,12	Indonesien
7-ELEVEN INC / 0,80% / 10.02.2024	G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,09	Japan
BANK OF BARODA (LONDON BRANCH) / 3,88% / 04.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,08	Indien
PANASONIC HOLDINGS CORP / 2,68% / 19.07.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,02	Japan
FAR EAST HORIZON LTD / 2,63% / 03.03.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,01	Hongkong

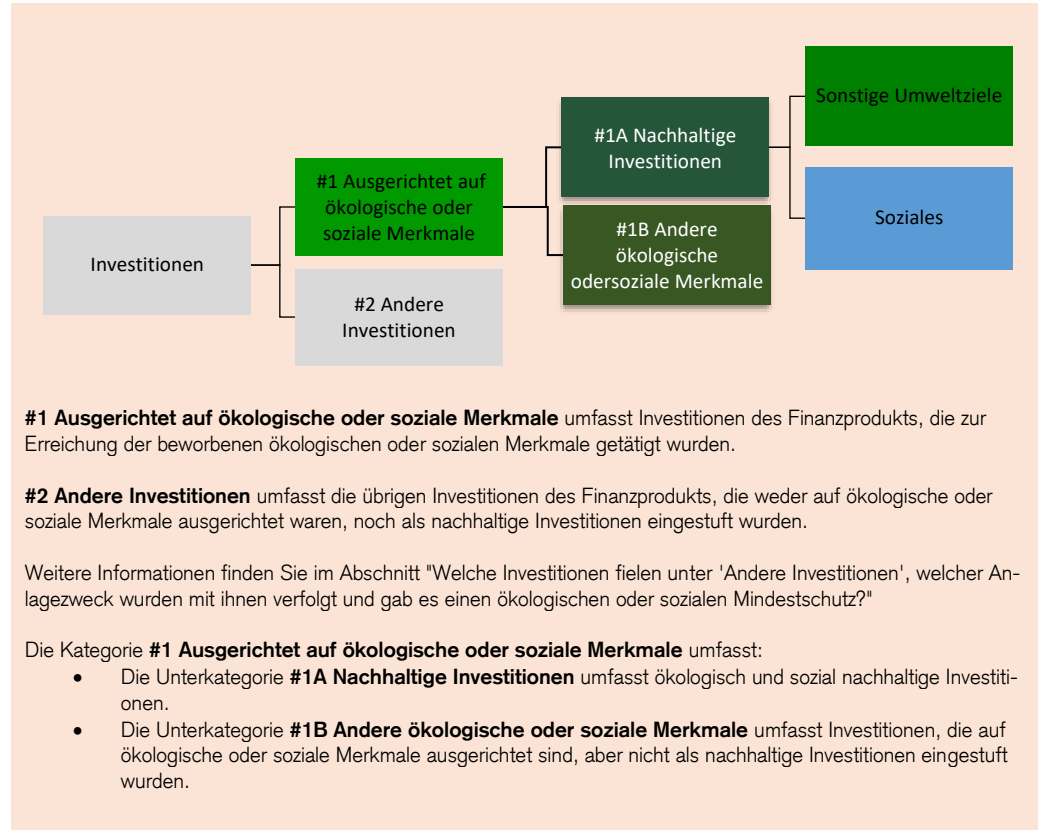
\* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 30.09.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



## 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 90,05% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 5,87 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 84,18% seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 9,95% seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 30.09.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

#### Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,99%
C. Verarbeitendes Gewerbe	8,07%
D. Energieversorgung	4,71%
F. Baugewerbe	4,70%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	6,98%
H. Verkehr und Lagerei	0,40%
J. Information und Kommunikation	2,09%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	66,31%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,33%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,32%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	1,12%
Andere	-0,03%

\* 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 30.09.2023. 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	1,45%
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	2,25%
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	0,58%

\* 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 30.09.2023. 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 CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin,



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

Zum 30.09.2023 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 sind<sup>1</sup>?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> 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.

dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

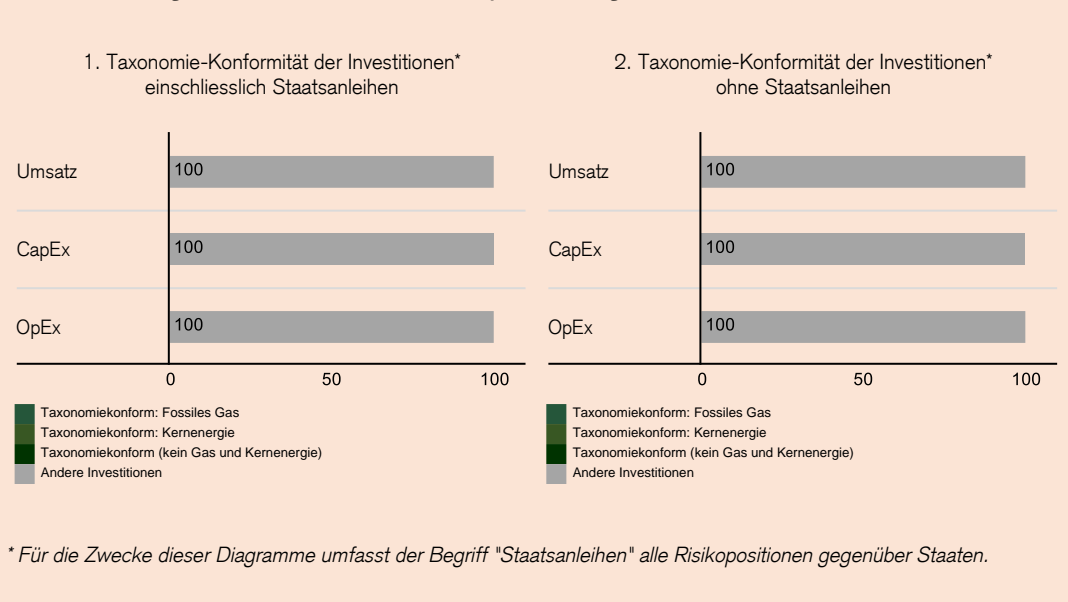
**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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 der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



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 30.09.2023 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?**

Ein Vergleich der Investitionen des Portfolios, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, mit den vorherigen Zeiträumen wird ab dem kommenden Bezugszeitraum zur Verfügung stehen.



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

Zum 30.09.2023 waren 4,42 % 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 30.09.2023 waren 1,45 % 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 30.09.2023 waren 9,95 % 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 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 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](http://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



## **MSCI-Haftungsausschluss**

Bestimmte Informationen ©2023 MSCI ESG Research LLC. Nachdruck mit Genehmigung. Wenngleich Credit Suisse Group AG und/oder ihre verbundenen Informationsanbieter, wie unter anderem MSCI ESG Research LLC und ihre verbundenen Unternehmen (die "ESG-Parteien"), Informationen aus Quellen beziehen, die sie für zuverlässig halten, geben die ESG-Parteien keine Zusicherungen oder Garantien bezüglich der Echtheit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit von hierin enthaltenen Daten ab und lehnen jegliche ausdrücklichen oder impliziten Zusicherungen ab, unter anderem bezüglich der Marktgängigkeit und der Eignung für einen bestimmten Zweck. Keine der ESG-Parteien haftet in irgendeiner Weise für Fehler oder Auslassungen im Zusammenhang mit hierin enthaltenen Daten oder für irgendwelche direkten oder indirekten Schäden, Folge- oder Sonderschäden, Schadenersatzforderungen mit Strafcharakter oder sonstige Schäden (einschliesslich entgangener Gewinn), auch wenn sie auf die Möglichkeit solcher Schäden hingewiesen wurden.

## **NACE-Quelle**

Eurostat

## **ESG-Erläuterungen**

Die in diesem Abschnitt enthaltenen Zahlen sind nicht geprüft. Bei Informationen, Aussagen und Wertungen in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung ("ESG") in diesem Bericht können sich Credit Suisse Group AG und/oder ihre verbundenen Unternehmen (nachfolgend "CS") teilweise oder vollständig auf öffentlich zugängliche Informationen, intern entwickelte Daten und/oder aus externen Quellen bezogene Informationen stützen, die CS für zuverlässig hält. Die Fähigkeit von CS, solche Ziele zu überprüfen, kann durch die Zuverlässigkeit der verfügbaren Daten über die zugrunde liegenden Vermögenswerte und den Status der Bestimmungen bezüglich des Verfolgens und Bereitstellens solcher Daten begrenzt sein. CS hat aus diesen öffentlich zugänglichen Quellen oder von Dritten bezogene Informationen nicht unabhängig überprüft und kann keine Zusicherungen oder Garantien bezüglich ihrer Richtigkeit, Vollständigkeit und Zuverlässigkeit abgeben. Es besteht die Möglichkeit, dass Daten von ESG-Datenanbietern nicht korrekt, nicht verfügbar oder nicht vollständig aktuell sind. Dies gilt insbesondere, wenn CS nur begrenzten Zugang zu Daten von externen Parteien bezüglich der einer Anlage zugrunde liegenden Elemente hat, beispielsweise aufgrund des Mangels an Look-through-Daten. Eine solche Datenlücke könnte zu einer falschen Bewertung einer Nachhaltigkeitspraxis und/oder damit verbundener Nachhaltigkeitsrisiken und -chancen führen. CS kann keine Garantien zum Inhalt oder zur Vollständigkeit solcher ESG-Offenlegungen geben, die sich ändern können und nicht als verlässliche Quelle herangezogen werden können. CS haftet insbesondere nicht für Fehler oder Auslassungen im Zusammenhang mit hierin enthaltenen ESG-Daten oder für irgendwelche direkten oder indirekten Schäden, Folge- oder Sonderschäden, Schadenersatzforderungen mit Strafcharakter oder sonstige Schäden (einschliesslich entgangener Gewinn). Da es kein standardisiertes, branchenweites ESG-Klassifikationssystem gibt, hat CS ihren eigenen ESG-Rahmen entwickelt (das "CS Sustainable Investment Framework"). Anleger sollten daher zur Kenntnis nehmen, dass die ESG-Klassifikation der Subfonds die Meinung von CS widerspiegelt und auf dem CS Sustainable Investment Framework basiert, dessen Klassifikation von der von Dritten gemachten Klassifikation abweichen kann. Die Tatsache, dass sich ein Subfonds an das CS Sustainable Investment Framework hält, bedeutet nicht zwangsläufig, dass er den allgemeinen Anlagezielen oder Nachhaltigkeitspräferenzen der Anleger entspricht. Da Bestimmungen und Richtlinien zur Nachhaltigkeit sich weiterentwickeln, muss CS mitunter ESG-Klassifikationen/Beschreibungen überarbeiten, wenn sich die gängige Branchenpraxis ändert und mehr aufsichtsrechtliche Orientierung verfügbar wird. Die ESG-Performance eines Portfolios kann auch von seiner finanziellen Performance abweichen, und CS kann keine Zusicherung bezüglich der Korrelation zwischen finanzieller und ESG-Performance machen. Nachhaltigkeitsbezogene Praktiken unterscheiden sich zudem nach Region, Branche und ESG-Themen und entwickeln sich ständig weiter. Folglich können sich nachhaltigkeitsbezogene Praktiken im Laufe der Zeit ändern. Ebenso können neue lokale Nachhaltigkeitsanforderungen zu zusätzlichen Compliance-Kosten, Offenlegungspflichten oder sonstigen Einschränkungen für den Subfonds führen. Auch die Einschätzung der geeigneten Klassifikation durch CS kann sich im Laufe der Zeit ändern, unter anderem in Reaktion auf aufsichtsrechtliche Vorgaben oder die Änderung des branchenspezifischen Ansatzes der Klassifikation. Eine Änderung an der massgebenden Klassifikation kann weitere Massnahmen erforderlich machen, z. B. weitere Offenlegungen oder neue Prozesse für die Erfassung von Daten, was zu zusätzlichen Kosten führen kann.

**CREDIT SUISSE**   
Teil des UBS-Konzerns

CS Investment Funds 3  
5, rue Jean Monnet  
L-2180 Luxembourg  
[www.credit-suisse.com](http://www.credit-suisse.com)