

CS Investment Funds 1

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital

luxemburgischen Rechts – R.C.S. Luxembourg B131404

**Geprüfter Jahresbericht zum
31.10.2023**

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
Bericht des Verwaltungsrats (ungeprüft)	5
Prüfungsvermerk	7
Kombinierter Bericht	13
Erläuterungen	15
Tätigkeitsbericht (ungeprüft)	21
Bericht per Subfonds	
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)	25
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	33
Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)	41
Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund	45
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	50
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	59
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	66
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	75
Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund	82
Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund	87
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	92
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	98
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund	104
Ungeprüfte Informationen	109
Gesamtvergütung	109
Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT") und Total-Return-Swaps ("TRS")	109
Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen	111

Verwaltung und Organe

Die Gesellschaft

CS Investment Funds 1
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg
R.C.S. Luxemburg B 131404

Verwaltungsrat der Gesellschaft

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

Marc Berryman (sei dem 10.03.2023)
Director, Credit Suisse Asset Management Limited

Evanthi Savoulidi (seit dem 13.04.2023)
Director, Credit Suisse Fund Management S.A.

Petra Borisch (seit dem 13.04.2023)
Director, Credit Suisse Fund Management S.A.

Eduard von Kymmel
Independent Director, Luxemburg

Jonathan Griffin
Independent Director, Luxemburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft

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

Verwaltungsgesellschaft

Credit Suisse Fund Management S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg
R.C.S. Luxemburg B 72925

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 Luxembourg

Depotbank

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

Zentrale Verwaltungsstelle

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

Anlageverwalter

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

- Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)
- Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund
- Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund
- Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund

Credit Suisse Investment Partners (Switzerland) Ltd. ("CSIP")

- Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund
- Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund
- Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)

Credit Suisse Asset Management LLC
11 Madison Avenue, New York, NY 10010, USA

- Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund

Credit Suisse Asset Management LLC
One Madison Avenue, New York, NY 10010, USA
und
Credit Suisse Asset Management Limited
One Cabot Square, London E1440J
(Co-Anlageverwalter)

- Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund

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

Vertriebsstelle

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

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 SICAV veröffentlicht. Der Nettoinventarwert wird ausserdem täglich im Internet unter 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 Berichtsjahres 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 SICAV 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 13. April 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 13. April 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, Verwaltungsratsmitglied (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.

Bericht des Verwaltungsrats (ungeprüft)

Fondsstruktur

CS Investment Funds 1 (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 21. August 2007 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. Oktober 2023 hatte der Fonds 12 Subfonds mit Aktienklassen, die für Angebot und Vertrieb im Grossherzogtum Luxemburg und in den folgenden Ländern registriert sind: Australien, Bahrain, Chile, Deutschland, Finnland, Frankreich, Gibraltar, Italien, Liechtenstein, Niederlande, Norwegen, Österreich, Saudi-Arabien, Schweden, Schweiz, Singapur, Spanien, Tschechische Republik 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. Oktober 2023 setzte sich der Verwaltungsrat aus einem von Credit Suisse Asset Management, UK beschäftigten Verwaltungsratsmitglied und zwei von Credit Suisse Fund Management S.A. beschäftigten 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 anberaunt.

Verkaufsprospekt

Der Verkaufsprospekt des Fonds wurde zuletzt im Januar 2024 geändert.

Jahreshauptversammlungen

Die nächste Jahreshauptversammlung des Fonds (die "Jahreshauptversammlung") findet am Dienstag, den 11. April 2024 am eingetragenen Sitz des Fonds statt, um Angelegenheiten in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 30. Oktober 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.

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.



Audit report

To the Shareholders of
CS Investment Funds 1

Our opinion

In our opinion, the accompanying financial statements give a true and fair view of the financial position of CS Investment Funds 1 (the “Fund”) and of each of its sub-funds as at 31 October 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 31 October 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 31 October 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.

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

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



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

Responsibilities of the Board of Directors of the 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) Credit Special Situation Fund for which the liquidation process has been initiated since the 21.07.2023 and Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund which has been put into liquidation as of 15.11.2023) to cease to continue as a going concern;
- evaluate the overall presentation, structure and content of the financial statements, including the disclosures, and whether the financial statements represent the underlying transactions and events in a manner that achieves fair presentation.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Represented by

Luxembourg, 2 February 2024

Sandra Paulis



An die Aktionäre der

CS Investment Funds 1

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der CS Investment Funds 1 und seiner jeweiligen Subfonds („der Fonds“) zum 31. Oktober 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 der jeweiligen Subfonds zum 31. Oktober 2023;
- der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung / der Veränderung des Nettovermögens des Fonds und der Ertrags- und Aufwandsrechnung / der Veränderung des Nettovermögens der jeweiligen Subfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr;
- der Aufstellung des Wertpapierbestandes zum 31. Oktober 2023; und
- einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden und anderen erläuternden Informationen (Anhang).

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz 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 (ISA) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und ISAs wie für Luxemburg angenommen durch CSSF, diesem Gesetz und diesen Standards 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 und der für die Überwachung Verantwortlichen 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 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, 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 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 (ausser für den Subfonds Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund, für den ab dem 21.07.2023 der Liquidationsprozess eingeleitet wurde, und für den Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund, der ab dem 15.11.2023 in Liquidation gesetzt wurde) seine Tätigkeit nicht mehr fortführen kann;
- 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

Luxemburg, 2 Februar 2024

Vertreten durch

Sandra Paulis

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

Nettovermögensaufstellung (in CHF)

31.10.2023

Aktiva

Wertpapierbestand zum Marktwert	3.044.138.456,14
Bareinlagen bei Banken und Brokern	78.341.949,12
Forderungen aus Zeichnungen	4.015.102,24
Forderungen aus Erträgen	29.520.326,98
Kostenerstattung	1.260,35
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten	6.585.669,49
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	10.369.004,67
Andere Aktiva	12.588,10
	3.172.984.357,09

Passiva

Bankverbindlichkeiten und sonstige	10.137.097,24
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	1.169.982,35
Rückstellungen für Aufwendungen	1.422.121,73
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	4.645.709,05
Andere Passiva	3.389,54
	17.378.299,91

Nettovermögen **3.155.606.057,18**

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens (in CHF)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	4.476.992.622,26
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	124.091.768,36
Dividenden (Netto)	854.724,21
Bankzinsen	3.024.224,08
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.076.130,12
Andere Erträge	314.798,14
	130.361.644,91
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	14.598.311,62
Depotbank- und Depotgebühr	2.173.781,30
Zentralverwaltungsvergütung	1.915.466,80
Erstattete oder erlassene Kosten	-22.322,93
Druck- und Veröffentlichungskosten	265.148,39
Zinsen und Bankspesen	212.522,97
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	2.857.456,71
"Taxe d'abonnement"	627.423,44
	22.627.788,30
Nettoerträge (-verluste)	107.733.856,61
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-227.006.319,15
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	1.167.879,03
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	44.892.663,47
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	81.622.320,15
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-609,75
	-99.324.066,25
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	8.409.790,36
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	340.376.775,53
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	-77.282,74
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-39.017.136,15
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-50.474.762,61
	250.807.594,03
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	259.217.384,39
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	517.340.961,71
Rücknahmen	-1.719.456.053,89
	-1.202.115.092,18
Ausschüttung	-18.500.976,34
Währungsdifferenz	-359.987.880,95
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	3.155.606.057,18

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Allgemeines

CS Investment Funds 1 (die "Gesellschaft") ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren in der Rechtsform einer Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (société d'investissement à capital variable, SICAV) gemäss Teil 1 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils geltenden Fassung (das "Gesetz vom 17. Dezember 2010") zur Umsetzung von Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren.

Zum 31.10.2023 hatte die Gesellschaft 12 Subfonds aufgelegt.

Änderungen:

Mit Wirkung zum 12.12.2022 wurde der Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund in Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund umbenannt.

Ab dem 21.07.2023 wurde der Liquidationsprozess des Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund eingeleitet.

Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

a) Darstellung des Abschlusses

Der Abschluss wurde gemäss den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen für Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren erstellt. Grundlage des Abschlusses ist der letzte während des Berichtszeitraums (d. h. am 31.10.2023) berechnete Nettoinventarwert. 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) Credit Special Situation Fund, für den ab dem 21.07.2023 der Liquidationsprozess eingeleitet wurde, und des Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund, der am 15.11.2023 in Liquidation gesetzt wurde.

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. Der Abschluss berücksichtigt die Nettoinventarwerte zum 31.10.2023, die auf den Marktpreisen der Anlagen vom 31.10.2023 basieren.

Der Anlageverwalter muss Transaktionen ausführen, um die gewünschte Allokation nach Zeichnungen oder Rücknahmen aufrechtzuerhalten. Hierdurch können zusätzliche Kosten für den Subfonds und die Aktionäre 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 Subfonds durch diese Transaktionen entstehen können, sowie die geschätzte Geld-Briefkurs-Spanne der Vermögenswerte, in die der Fonds investiert. Es werden regelmässige Überprüfungen durchgeführt, um festzustellen, ob der angewendete Swing-Faktor angemessen ist.

Für die aktiven Subfonds wird der berechnete Nettoinventarwert um bis zu maximal 2% je Aktie erhöht, wenn es zu einem Nettoüberschuss an Zeichnungsanträgen kommt, oder um bis zu maximal 2% pro Aktie verringert, wenn es zu einem Nettoüberschuss an Rücknahmeanträgen kommt. Dies geschieht auf der Grundlage der an dem betreffenden Bewertungstag eingegangenen Anträge.

Der NIW je Aktie, der in den statistischen Informationen angegeben wird, ist der veröffentlichte NIW je Aktie, während das Gesamtnettvermögen, das in der Aufstellung des Nettvermögens aufgeführt ist, das Gesamtnettvermögen ohne Swing-Anpassung zum Jahresende ist.

Zum 31.10.2023 wurde kein Swing-Pricing auf die Subfonds angewendet.

c) Bewertung des Wertpapierbestands des jeweiligen Subfonds

Wertpapiere, die an einer Börse notiert sind, werden zum letzten Handelskurs bewertet. Ist ein solcher Kurs für einen bestimmten Handelstag nicht verfügbar, kann der Schlussgeldkurs als Grundlage der Bewertung verwendet werden. Wenn ein Wertpapier an mehreren Börsen gehandelt wird, erfolgt die Bewertung unter Bezugnahme auf die Börse, an der es vorwiegend gehandelt wird.

Im Fall von Wertpapieren, die nur in geringem Masse an einer Börse gehandelt werden, für die es jedoch einen geregelten Handel unter Wertpapierhändlern an einem Sekundärmarkt gibt, kann sich die Bewertung auf diesen Sekundärmarkt stützen. An einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden auf dieselbe Weise wie an einer Wertpapierbörse notierte Wertpapiere bewertet.

Wertpapiere, die nicht an einer Börse notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zu ihrem letzten verfügbaren Marktpreis bewertet. Ist ein solcher Preis nicht verfügbar, bewertet die Gesellschaft die Wertpapiere entsprechend anderen vom Verwaltungsrat festzulegenden Kriterien und auf der Grundlage des wahrscheinlichen Verkaufspreises, dessen Wert mit gebührender Sorgfalt und in gutem Glauben veranschlagt wird.

Aktien und Anteile an OGA werden auf Basis ihres jüngsten berechneten Nettoinventarwerts bewertet, wobei gegebenenfalls zu zahlende Rücknahmegebühren berücksichtigt werden. Sofern für Aktien oder Anteile solcher OGA kein Nettoinventarwert, sondern nur Kauf- und Verkaufspreise vorliegen, können die Anteile zum Mittelwert dieser Kauf- und Verkaufspreise berechnet werden.

Die sich aus diesen Bewertungen ergebenden Beträge werden zum geltenden mittleren Marktkurs in die Referenzwährung des betreffenden Subfonds umgerechnet.

Wenn eine Bewertung gemäss den vorstehenden Regeln aufgrund besonderer oder geänderter Umstände nicht möglich oder fehlerhaft ist, kann der Verwaltungsrat der Gesellschaft andere allgemein anerkannte und prüffähige Bewertungsgrundsätze anwenden, um die Vermögenswerte des Subfonds zu bewerten. Aufgrund der inhärenten Unsicherheit können diese geschätzten Werte deutlich von den Werten abweichen, die verwendet worden wären, hätte ein aktiver Markt für die Wertpapiere bestanden, sowie von den Werten, die gegebenenfalls letztlich erzielt werden.

d) Guthaben bei Banken und Maklern

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

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

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

f) Währungsumrechnung

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

Bankguthaben und sonstige Nettvermögenswerte 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.

Realisierte Währungsgewinne oder -verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderungen des Nettvermögens" ausgewiesen.

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

g) Buchung von Wertpapiertransaktionen der einzelnen Subfonds

Die Wertpapiergeschäfte werden an den Transaktionstagen gebucht.

h) Bewertung von Finanzterminkontrakten jedes Subfonds

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

i) Bewertung von Devisenterminkontrakten jedes Subfonds

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

j) Bewertung von Swap-Kontrakten jedes Subfonds

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

Asset-Swap-Kontrakte und die mit den Asset-Swap-Kontrakten verbundenen Wertpapiere werden nicht neu bewertet, da das Wertpapier und der Asset-Swap-Kontrakt für die Zwecke der Bewertung als ein einziges Instrument betrachtet werden, und nicht realisierte Ergebnisse werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" verbucht und unter dem "Nicht realisierten Nettogewinn/-verlust aus Swap-Kontrakten" in der Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen.

k) Zuordnung der Aufwendungen

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

l) Wertpapierleihe

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.

m) Buchung von Erträgen

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

n) Bewertung von Optionen jedes Subfonds

Noch nicht fällige Optionen werden mit den am Bewertungstag gültigen Marktsätzen bewertet, und die daraus resultierenden Veränderungen der nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" verbucht.

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 Aktienklasse in dem entsprechenden Monat.

Für die Aktienklassen 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, mit Ausnahme der Depotbankgebühren. Diese Gebühr beträgt höchstens 0,35% p.a.

Für die Aktienklassen DAP, DAHP, DBP und DBHP wird keine Verwaltungsgebühr erhoben, sondern lediglich eine Gebühr für Verwaltungsdienstleistungen, die an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen ist und alle Gebühren und Aufwendungen abdeckt, mit Ausnahme der Depotbankgebühren. Diese Gebühr beträgt höchstens 0,35% p.a. Darüber hinaus ist eine Performancegebühr an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen.

Performancegebühr

Zusätzlich zu den Verwaltungsgebühren fällt für folgende Subfonds eine Gebühr an, die an die Wertentwicklung des vom betreffenden Anlageverwalter verwalteten Vermögens gebunden ist (die "Performancegebühr"):

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)

Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)

Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund

Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund

Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund

Im Folgenden ist die Methode für die Berechnung der Performancegebühr für Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023) und Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund erläutert:

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf eine Performancegebühr, die bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der betreffenden Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing vor Rückstellung der Performancegebühr für den betreffenden Bewertungstag der betreffenden Aktienklasse ("Bewertungstag") berechnet wird.

Die Performancegebühr wird nur fällig und zurückgestellt, wenn die folgenden zwei Kriterien gleichzeitig erfüllt sind:

a) Die Performance des täglich ohne Anwendung des Swing-Pricing berechneten Nettoinventarwerts einer Aktienklasse muss grösser sein als die Performance des weiter unten näher beschriebenen Referenzwertes ("Hurdle-Rate-Index-Wert"), der ebenfalls täglich berechnet wird. Zum Zeitpunkt der Auflegung ist der Hurdle-Rate-Index-Wert gleich dem Ausgabepreis der betreffenden Aktienklasse.

b) Der Nettoinventarwert einer Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing, der für die Berechnung der Performancegebühr verwendet wird, muss grösser sein als die vorherigen Nettoinventarwerte ohne Anwendung des Swing-Pricing ("High Water Mark"). Jeder vorangegangene Rückgang des Nettoinventarwerts pro Aktie der betreffenden Aktienklasse ohne Anwendung von Swing-Pricing muss durch einen weiteren Anstieg über den letzten Höchstwert, bei dem eine Performancegebühr festgeschrieben wurde, ausgeglichen werden.

Der unter a) weiter oben erwähnte Hurdle-Rate-Index-Wert besteht aus dem Referenzzinssatz, der vom Benchmark-Administrator für die jeweilige Referenzwährung der Aktienklasse gemäss untenstehender Tabelle festgesetzt, um 100 Basispunkte erhöht und täglich auf indexierter Basis berechnet wird.

Referenzwährung der Aktienklasse	Referenzzinssatz	Vergleichsindex Verwalter
USD	SOFR	FED
EUR	ESTR	EZB
CHF	SARON	SIX
GBP	SONIA	BOE
JPY	TONAR	BOJ

Die Berechnung der Performancegebühr und der erforderlichen Rückstellung erfolgt täglich.

Wenn der Nettoinventarwert einer Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing am Berechnungstag über dem Hurdle-Rate-Index-Wert liegt und höher ist als die vorherigen Nettoinventarwerte ohne Anwendung des Swing-Pricing (vor Abzug der Performancegebühr), wird eine Performancegebühr von 15% der Differenz zwischen dem Nettoinventarwert der Aktienklasse ohne Anwendung von Swing-Pricing und dem grösseren der Werte Hurdle-Rate-Index-Wert und High Water Mark abgezogen. Die Berechnung der Performancegebühr erfolgt auf der Grundlage der zu diesem Zeitpunkt in Umlauf befindlichen Aktien der betreffenden Aktienklasse.

Die Zahlung der Beträge der Performancegebühr, die nach der oben beschriebenen Methode berechnet und rückgestellt werden, erfolgt zu Beginn des folgenden Quartals.

Diese Performancegebühr kann nicht zurückerstattet werden, wenn der Nettoinventarwert ohne Anwendung des Swing-Pricing nach Abzug der Performancegebühr wieder fällt. Das bedeutet, dass eine Performancegebühr auch fällig werden und gezahlt werden kann, wenn der Nettoinventarwert pro Aktie der jeweiligen Klasse ohne Anwendung des Swing-Pricing am Ende des Quartals niedriger ist als der Wert zu Beginn des Quartals.

Zum Jahresende wurde keine Performancegebühr erhoben.

Für Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund:

Alle aktiven Aktienklassen unterliegen keiner Performancegebühr. Während des Berichtsjahres wurde für den Subfonds keine Performancegebühr erhoben.

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund):

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf eine Performancegebühr, die bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der betreffenden Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing berechnet wird. Die Performancegebühr wird nur fällig und kristallisiert, wenn die folgenden Bedingungen gleichzeitig erfüllt sind:

a. Der Nettoinventarwert einer Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing, der für die Berechnung einer Performancegebühr verwendet wird, muss grösser sein als die vorherigen Nettoinventarwerte ohne Anwendung des Swing-Pricing ("High Water Mark"). Jeder vorangegangene Rückgang des Nettoinventarwerts pro Anteil der betreffenden Anteilsklasse ohne Anwendung von Swing Pricing muss mit einem weiteren Anstieg über den letzten Höchstwert verrechnet werden, bei dem eine Performancegebühr anfällt.

b. Die Performance des täglich berechneten Nettoinventarwerts einer Aktienklasse muss eine vierteljährliche Performance von 1,25% (bis 12.12.2022) und 1,00% (seit 12.12.2022) (die "Hurdle Rate") übersteigen (der "Hurdle-NIW").

Der Hurdle-NIW wird zu Beginn jedes Quartals zurückgesetzt, um mit dem letzten Nettoinventarwert zu beginnen, der im vorangegangenen Quartal berechnet wurde und als Basis für die Berechnung des neuen Hurdle-NIW verwendet wird.

Die Berechnung der Performancegebühr und der erforderlichen Rückstellung und Kristallisierung erfolgt bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts.

Wenn der Nettoinventarwert einer Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing am Berechnungstag höher ist als der Hurdle-NIW und über der High Water Mark liegt, wird eine Performancegebühr von 20% der Differenz zwischen dem Nettoinventarwert der Aktienklasse ohne Anwendung von Swing-Pricing und dem grösseren der Werte High Water Mark und Hurdle-NIW abgezogen. Die Performancegebühr wird auf der Grundlage der zu diesem Zeitpunkt im Umlauf befindlichen Aktien der betreffenden Aktienklasse berechnet.

Die Zahlung der Beträge der Performancegebühr, die nach der oben beschriebenen Methode berechnet und kristallisiert werden, erfolgt zu Beginn des folgenden Quartals.

Diese Performancegebühr kann nicht zurückerstattet werden, wenn der Nettoinventarwert ohne Anwendung des Swing-Pricing nach Abzug der Performancegebühr wieder fällt. Das bedeutet, dass eine Performancegebühr auch fällig werden und gezahlt werden kann, wenn der Nettoinventarwert pro Aktie der jeweiligen Klasse ohne Anwendung des Swing-Pricing am Ende des Quartals niedriger ist als der Wert zu Beginn des Quartals.

Aktienklasse	Währung	Satz der Performancegebühr	Betrag der für das Jahr berechneten Performancegebühr	Auf den NIW der Aktienklasse für das Jahr erhobene Performancegebühr in %
IBHP	CHF	20%	-	-
IBHP	EUR	20%	-	-

Zum Jahresende wurde keine Performancegebühr erhoben.

Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023):

Aktienklasse	Währung	Satz der Performancegebühr	Betrag der für das Jahr berechneten Performancegebühr	Auf den NIW der Aktienklasse für das Jahr erhobene Performancegebühr in %
IA	USD	15%	-	-
IB	USD	15%	-	-
QA	USD	15%	-	-
QAH	CHF	15%	-	-
QAH	EUR	15%	-	-

Zum Jahresende wurde keine Performancegebühr erhoben.

Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund und Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund:

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf eine Performancegebühr für die Aktienklasse DBP (die "Aktienklasse"), die auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing berechnet wird.

Die Performancegebühr ist für jeden Referenzzeitraum ("Referenzzeitraum") zahlbar. Sofern zwischen den Parteien nichts anderes vereinbart wird, beginnt der erste Referenzzeitraum mit der Auflegung der Aktienklasse und endet am letzten Tag des Berichtszeitraums.

Die Berechnung der Performancegebühr und der erforderlichen Rückstellung erfolgt bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts. Die aufgelaufene Performancegebühr ist jährlich rückwirkend innerhalb eines Monats nach Ende des betreffenden Referenzzeitraums zahlbar, und im Falle von Rücknahmen von Aktien während des Referenzzeitraums wird der im Nettoinventarwert je Aktie enthaltene Betrag der Performancegebühr für diese zurückgenommenen Aktien zum Zeitpunkt der Rücknahme fällig und geschuldet (d. h. kristallisiert), wenn folgende Bedingungen erfüllt sind:

(i) Der Nettoinventarwert der Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing, der für die Berechnung einer Performancegebühr verwendet wird, muss grösser sein als der höchste NIW (vor Abzug der Performancegebühr) am Ende eines Performancezeitraums, in dem eine Performancegebühr gezahlt wurde ("High Water Mark").

(ii) Der prozentuale Anstieg des Nettoinventarwerts pro Aktie über den Performancezeitraum ist grösser als der prozentuale Anstieg der für die Aktienklasse verwendeten Benchmark über denselben Performancezeitraum.

Die Berechnung der Performancegebühr und die erforderliche Rückstellung erfolgten bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts. Die Performancegebühr wird jedoch erst am Ende des Referenzzeitraums kristallisiert und wenn Aktien während des Referenzzeitraums zurückgenommen werden. Falls dieser Betrag negativ ist, wird der negative Betrag auf den nächsten Referenzzeitraum übertragen.

Wenn der Nettoinventarwert der Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing am Berechnungstag über der Benchmark liegt und grösser ist als die High Water Mark, wird eine Performancegebühr von 15% für den Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund und 20% für den Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund der Differenz zwischen dem Nettoinventarwert der Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing und dem grösseren der Werte Benchmark und High Water Mark abgezogen. Die Performancegebühr wird auf der Grundlage der zu diesem Zeitpunkt im Umlauf befindlichen Aktien der Aktienklasse berechnet.

Beim Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund darf der für den jeweiligen Referenzzeitraum zu zahlende Betrag der Performancegebühr nicht grösser sein als 0,50% des durchschnittlichen NIW der Aktienklasse während dieses Referenzzeitraums.

Alle aktiven Aktienklassen unterliegen keiner Performancegebühr. Während des Berichtsjahres wurde für die Subfonds keine Performancegebühr erhoben.

"Taxe d'abonnement"

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

Diese Steuer gilt nicht für diejenigen Vermögenswerte des Fonds, die in anderen Organismen für gemeinsame Anlagen nach luxemburgischem Recht angelegt werden.

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

Die TER entspricht der Summe aller Kosten und Provisionen, die den Vermögenswerten des Fonds laufend belastet werden und rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Vermögens ausgedrückt werden.

Wenn ein Subfonds mindestens 10% seines Nettovermögens in Zielfonds investiert, wird eine zusammengesetzte TER des Dachfonds wie folgt berechnet:

Diese TER entspricht der Summe der anteilmässigen TER der einzelnen Zielfonds, einschliesslich einer etwaigen an die Wertentwicklung gebundenen Vergütung, gewichtet nach deren Anteil am Nettovermögen des Dachfonds, und der TER des Dachfonds per Bilanzstichtag des Dachfonds, abzüglich der im Berichtszeitraum vereinnahmten Retrozessionen von Zielfonds. Die TER wird nach der Asset Management Association Switzerland-Richtlinie (AMAS) berechnet.
Für Aktienklassen, die weniger als 6 Monate vor Abschluss aufgelegt oder während des Berichtszeitraums geschlossen wurden, wird keine TER ausgewiesen.

Wechselkurse

Der konsolidierte Abschluss wird in CHF erstellt. Zu diesem Zweck wird der Abschluss der einzelnen Subfonds zu den am 31.10.2023 geltenden Wechselkursen in CHF umgerechnet:

1 EUR = 0,961950 CHF
1 USD = 0,910076 CHF

Fondsperformance

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

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

Die Performance seit Jahresbeginn (YTD) bezieht sich auf den Zeitraum vom 01.01.2023 bis zum 31.10.2023.

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 Subfonds erhobene Kosten und Provisionen nicht berücksichtigt.

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

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

Subfondsübergreifende Anlagen

Folgende Anlagen wurden nicht aus den konsolidierten Zahlen herausgenommen.

Am 31.10.2023 würde sich der gesamte konsolidierte NIW ohne diese Anlagen auf CHF 3.152.021.884,18 belaufen.

	Bewertung (in USD)
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund investiert in:	
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund -DA- USD	3.938.324,07

Transaktionskosten

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

In dem am 31.10.2023 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	Betrag
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)	USD	48.423,03
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	EUR	0,00

Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund	EUR	75,00
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	USD	234,49
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund	USD	1.426,18
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	USD	1.445,20
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	USD	809,18
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund	USD	388,50

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

Wertpapierleihe

Per 31.10.2023 partizipierten die Subfonds wie folgt am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich (der "Principal"):

Subfonds	Währung	Marktwert der Wertpapierleihe	Marktwert der Sicherheiten
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)	USD	42.771.476,00	44.978.823,96
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	EUR	27.668.501,00	29.096.415,47
Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund	EUR	31.339.062,00	32.956.406,57
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	USD	51.630.353,00	54.294.889,40
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	USD	17.463.788,00	18.365.058,20
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	USD	22.092.990,00	23.233.163,80
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	USD	3.876.771,00	4.076.843,18
Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund	USD	322.530,00	339.175,11
Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund	USD	22.720.206,00	23.892.749,13
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	USD	32.782.482,00	34.474.318,51
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	USD	3.330.194,00	3.502.058,47
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund	USD	5.285.855,00	5.558.647,11

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 am 31.10.2023 abgeschlossene Geschäftsjahr beliefen sich die an den Principal und die Subfonds gezahlten Gebühren auf folgende Beträge:

Subfonds	Art	Gegenpartei	Betrag
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	Barmittel	BNP Paribas	USD 2.120.000
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	Barmittel	Morgan Stanley Capital Group (New York)	USD 1.090.000

Subfonds	Währung	Aufwendungen und Provisions von der Gegenpartei der Wertpapierleihegeschäfte		Nettobetrag
		Bruttobetrag Wertpapierleihe	Wertpapierleihegeschäfte	
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)	USD	913.251,93	235.792,83	677.459,10
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	EUR	300.570,03	81.154,75	219.415,28
Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)	USD	80.813,76	24.052,09	56.761,67
Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund	EUR	139.701,06	33.870,38	105.830,68
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	USD	539.256,93	131.072,92	408.184,01
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	USD	86.936,86	23.829,67	63.107,19
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	USD	259.159,04	62.357,64	196.801,40
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	USD	19.375,03	4.751,79	14.623,24
Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund	USD	2.665,96	703,65	1.962,31
Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund	USD	192.913,25	47.148,69	145.764,56
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	USD	299.201,19	75.353,17	223.848,02
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	USD	115.471,79	29.391,81	86.079,98
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund	USD	84.090,40	21.506,60	62.583,80

Risikomanagement

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

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 Gegenparteirisiko zu mindern. Für andere Arten von Derivaten können Margenkonto genutzt werden.

Per 31.10.2023 haben folgende Subfonds folgende Vermögenswerte als Sicherheit von folgenden Gegenparteien in folgender Höhe erhalten, um das Gegenparteirisiko zu mindern:

Barsicherheiten

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

Subfonds	Art	Gegenpartei	Betrag
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	Barmittel	JPMorgan Chicago	EUR 1.000.000
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	Barmittel	JPMorgan Chicago	USD 455.000
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	Barmittel	Credit Suisse (Schweiz) AG	USD 110.000
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	Barmittel	Goldman Sachs International London	USD 30.000
		JPMorgan Chicago	USD 4.461.077,01
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	Barmittel	Credit Suisse (Schweiz) AG	USD 130.000

Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes

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.

Kostenerstattung

Seit Anfang November 2021 zahlt der Subfonds Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund Aufwendungen auf der Grundlage einer nach oben begrenzten TER (Verwaltungsgebühren + 20 Basispunkte). Der Gesamtbetrag der dem Subfonds tatsächlich entstandenen Aufwendungen wird monatlich ermittelt und mit dem kumulierten Betrag der auf der Grundlage der nach oben begrenzten TER berechneten Aufwendungen verglichen. Wenn die Höhe der Aufwendungen die Obergrenze übersteigt, wird die Differenz als Minderung der Aufwendungen verbucht (der "Kostenerlass"). Der Kostenerlass wird der Credit Suisse Fund Management S.A. monatlich in Rechnung gestellt. Die Höhe des Kostenerlasses wird in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" unter "Erstattete oder erlassene Kosten" ausgewiesen.

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.

Der neue Verkaufsprospekt trat im Mai 2023 in Kraft.

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

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, ab dem 15.11.2023 den Liquidationsprozess des Subfonds Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund einzuleiten.

Der neue Prospekt trat am 23.01.2024 in Kraft.

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)

Geopolitische Spannungen beherrschten 2023 weiterhin die Schlagzeilen, wobei sich der Fokus zum Ende des Berichtszeitraums auf den Nahen Osten verlagerte. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hielt an, und die Zinsen stiegen in allen bedeutenden Währungen erheblich. Ein Lichtblick ist, dass die jüngsten Nachrichten und die Preisgestaltung bei Anleihen-Futures darauf hindeuten, dass der Markt davon ausgeht, dass die Zinsen ihren Spitzenwert erreicht haben, zumindest im aktuellen Zyklus. Nach dem markanten Abverkauf an den Aktienmärkten im vorangegangenen Berichtszeitraum wurden die Verluste in den vergangenen zwölf Monaten zum Teil wieder wettgemacht. Bei genauerem Hinsehen stellt man fest, dass sich die Erholung von Aktien nicht geradlinig vollzog, sondern einen holprigen Weg zurücklegte, auf dem Large Caps in der Regel besser abschnitten. Small Caps entwickelten sich deutlich schlechter, was kaum überraschend ist, da der grössere Teil ihrer Gewinne tendenziell erst weiter in der Zukunft anfällt (z. B. im Biotechnologiesektor). Bei festverzinslichen Anlagen waren gemischte Ergebnisse zu verzeichnen. Während engere Kreditspreads hilfreich waren (und insbesondere Hochzinsstrategien und notleidenden Schuldtiteln zugutekamen), waren die höheren Zinsen es nicht. Vor diesem Hintergrund verzeichneten Wandelanleihen eine relativ gute Wertentwicklung. Nach einem Zeitraum schwacher Aktivitäten auf dem Primärmarkt zogen die Emissionsvolumen 2023 wieder an, woran Wandelanleihen mit Investment-Grade-Rating einen rekordhohen Anteil hatten.

Der Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund legte um 4,0% zu (ohne Kosten, abgesichert in USD) und schnitt damit etwas schlechter ab als seine Benchmark, die um 5,0% stieg. Der Fonds war über den gesamten Berichtszeitraum mit einem moderaten Long-Delta im Vergleich zur Benchmark positioniert und wies eine Allokation im Non-Investment-Grade-Segment zwischen 5% und 10% auf, vorwiegend im unteren Bereich dieser Spanne. Angesichts der maximalen High-Yield-Quote von 25% kann die jüngste Positionierung des Fonds in dieser Hinsicht als konservativ betrachtet werden. Das gesamte Volumen des Wandelanleihenmarktes blieb gemessen am Refinitiv Global Convertible Bond Index weitgehend unverändert bei knapp über 300 Milliarden USD, da das Volumen an Neuemissionen Fälligkeiten, Umwandlungen und Rückkäufe in etwa ausglich.

Zu Beginn des neuen Berichtszeitraums ist die Anlageklasse unseres Erachtens bestens aufgestellt, um von dem aktuellen Umfeld zu profitieren. Im Investment-Grade-Segment stieg die Aktiensensitivität (Delta) in der Anfangsphase des Berichtszeitraums und hielt sich dann die meiste Zeit in den ersten drei Quartalen des Jahres bei zwischen 45 und 50. Sie fiel dann in den letzten Wochen auf ein Niveau von etwa 40 zurück. Gegenwärtig werden fast 70% des Universums der Investment-Grade-Wandelanleihen mit einem Abschlag auf ihre Rücknahmekurse gehandelt und bieten daher eine positive Endfälligkeitsrendite. Die starken defensiven Eigenschaften des IG-Segments in Verbindung mit günstigen Bewertungen und einer angemessenen Aktiensensitivität werden auch in Zukunft Anleger anziehen. Zudem sind wir weiterhin optimistisch, dass der Primärmarkt für Investment-Grade-Emittenten weiterhin attraktiv bleibt, solange die Zinsen auf hohem Niveau verharren.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund

Sorgen über die Widerstandsfähigkeit des Bankensystems nach dem Zusammenbruch einiger Regionalbanken in den USA sowie die Übernahme von Credit Suisse durch UBS und die ständigen Abschreibungen der Additional-Tier-1-Anleihen von Credit Suisse im März 2023 vertrieben im ersten Quartal Anleger vom Markt für nachrangige Finanzanleihen. Strategien in nachrangigen Finanzanleihen verzeichneten bis zum letzten Quartal des Jahres Monat für Monat einen Nettomittelabfluss. Dieser Trend kehrte sich in der zweiten Jahreshälfte um, als das Szenario einer "sanften Landung" bei Anlegern die Runde machte und die Aktivitäten auf dem Markt für AT1-Emissionen im 4. Quartal wieder stark zunahm. Trotz des schwierigen Umfelds verzeichneten Banken im Grunde eine gute Performance, da Berichten beruhigende Kreditrends zu entnehmen waren, ebenso wie solide Fundamentaldaten mit kleinen Ertragsausschlägen, was vorwiegend von einer Ausweitung der Nettozinsmargen mit abnehmender Tendenz getragen wurde, und eine Verbesserung der Qualität der Aktiva. Währenddessen verloren US-Treasuries über das ganze Jahr an Boden und die 10-jährige Rendite stieg zum Ende des 3. Quartals 2023 auf 4,93% und kletterte im September kurz über die 5%-Marke. Die Zentralbanken weltweit reagierten und nahmen eine drastische Anhebung ihrer Leitzinsen vor, was zu erhöhter Volatilität und negativen Renditen auf den Finanzmärkten führte.

Trotz sich ausweitender Kreditspreads, insbesondere bei nachrangigen Finanzanleihen, erzielte der Subfonds im Berichtszeitraum eine positive Performance. Doch aufgrund einer niedrigen Zinsduration, die zusätzlich durch mehrere Zinsswaps reduziert werden konnte, blieb der Fonds vom erheblichen Anstieg der weltweiten Zinsen weitgehend verschont. Insgesamt erwies sich der Wertverlust als vergleichbar mit anderen Strategien im Segment der festverzinslichen Anlagen. Angesichts historisch attraktiver Bewertungen und da der grösste Teil des Universums nachrangiger Anleihen ein Verlängerungsrisiko eingepreist hatte, bevorzugten wir weiterhin Additional-Tier-1- und Restricted-Tier-1-Papiere. In dem volatilen aktuellen Umfeld halten wir an unserer insgesamt defensiven Positionierung fest. Die Emittenten- und Anleiheauswahl ist nach wie vor von entscheidender Bedeutung und wir bevorzugen weiterhin kürzere Strukturen ohne Kündigungsrecht von systemrelevanten europäischen Emittenten mit soliden Bilanzen und erheblichen Back-end-Spread-Puffern.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, den Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund zum 21.07.2023 zu liquidieren.

Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund

Der Berichtszeitraum wurde massiv beeinträchtigt von der anhaltenden Inflation in den ersten beiden Quartalen, Sorgen über die Widerstandsfähigkeit des Bankensystems nach dem Zusammenbruch einiger Regionalbanken in den USA und der Übernahme von Credit Suisse durch UBS und die ständigen Abschreibungen der Additional-Tier-1-Anleihen von Credit Suisse im März 2023 sowie von zunehmenden geopolitischen Spannungen im Nahen Osten zu Beginn des letzten Quartals 2023. US-Treasuries verloren über das ganze Jahr an Boden und die 10-jährige Rendite stieg zum Ende des 3. Quartals 2023 auf 4,93% und kletterte im September kurz über die 5%-Marke. Die Zentralbanken weltweit reagierten und nahmen eine drastische Anhebung ihrer Leitzinsen vor, was zu erhöhter Volatilität und negativen Renditen auf den Finanzmärkten führte. Sowohl die zinssensitiven festverzinslichen Anlagen als auch der Aktienmarkt gerieten unter Druck.

Der Subfonds verzeichnete über den Berichtszeitraum eine positive absolute Performance, was im Wesentlichen von der Positionierung in Anleihen getragen wurde, die von der Spreadverengung und dem generierten Carry profitierten. Zinsen waren die grösste Belastung, was durch höhere Zinsen auf Staatsanleihen bedingt war. Die relative Performance wurde weitgehend durch die Zinsentwicklung bestimmt, die aufgrund der längeren Duration gegenüber der Benchmark einen negativen Einfluss hatte. Das Gesamtrisiko des Fonds in Bezug auf Anleihen (gemessen an der Spread-Duration) blieb neutral, obwohl der Fonds weiterhin eine Übergewichtung in Anleihen mit BBB-Rating, Hochzinsanleihen und nachrangigen Wertpapieren hatte, sodass er eine etwas aggressivere Positionierung als die Benchmark aufwies. Bei der Positionierung auf der Zinsseite wurde die Duration im zweiten Quartal 2023 langsam erhöht, sodass er zum Ende des Berichtszeitraums im Vergleich zur Benchmark eine etwas längere Duration (+0,18 Jahre) aufwies.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund

Das Geschäftsjahr bis zum 31. Oktober 2023 war positiv für hochverzinsliche Anlagen, da eine robuste US-Wirtschaft und günstige technische Marktbedingungen die anhaltende Straffung der finanziellen Bedingungen ausglich. Nach den erheblichen Zinsanhebungen im Jahr 2022 hofften die Marktteilnehmer auf eine Mässigung der Straffung durch die Zentralbanken im Jahr 2023. Anfang 2023 verbesserte sich die Anlegerstimmung erheblich und blieb im Allgemeinen das ganze Jahr über positiv, da die Inflationszahlen nachgaben. Wenngleich einige zinsensensible und zyklische Bereiche der Wirtschaft Anzeichen eines Einbruchs erkennen liessen, konnten wir keine verbreiteten Hinweise auf eine Verschlechterung beobachten, und die Unternehmensbilanzen hielten sich relativ gut. Die Widerstandsfähigkeit der Wirtschaft insgesamt weckte Erwartungen von über längere Zeit höhere Zinsen. Die technischen Faktoren auf dem Hochzinsmarkt waren günstig, insbesondere aufgrund einer Welle von "Rising Stars", d. h. Anleihen, die von High Yield auf Investment Grade heraufgestuft wurden, sowie aufgrund von moderaten Neuemissionen und einem hohen Niveau der Wiederanlage von Kupons. Kapitalzuflüsse von Investmentfonds waren hingegen schwach.

Im Geschäftsjahr zum 31. Oktober 2023 leistete die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen einen positiven Beitrag zur relativen Performance des Fonds gegenüber dem Index. Unter den Sektoren leisteten Finanzdienstleistungen und Grundstoffindustrie die besten Beiträge zur Performance. Bei Finanzdienstleistungen trug die Titelauswahl zur Outperformance bei. In der Grundstoffindustrie leisteten die Titelauswahl und eine Übergewichtung gegenüber der Benchmark einen positiven Beitrag zur Outperformance. Freizeit und Telekommunikation schmälerten die Performance. Im Freizeitsektor belasteten sowohl die Titelauswahl als auch eine Untergewichtung gegenüber der Benchmark die Performance, während im Telekommunikationssektor die Titelauswahl negativ zu Buche schlug. Unter Rating-Gesichtspunkten leistete das Segment Caa1 dank der Titelauswahl einen positiven Beitrag zur Performance, während Ba3 aufgrund der Titelauswahl für die Performance von Nachteil war.

Der Hochzinsmarkt hat sich nach dem Schock durch die Zinsanhebungen im Jahr 2022 stabilisiert. Während einige Inflationszahlen nachgeben, bleibt der Arbeitsmarkt angespannt, und wir gehen davon aus, dass höhere Löhne mittelfristig die Unternehmensgewinne belasten werden. Dennoch sind Emittenten von Hochzinsanleihen weitgehend in guter Verfassung und werden es nach unserer Einschätzung trotz möglicherweise für längere Zeit höherer Zinsen auch bleiben. Über die Inflation und Zinsrisiken hinaus bestehen weitere Gefahren, darunter zunehmende geopolitische Spannungen im Nahen Osten, schwächelnde Verbraucherausgaben in den USA und Stillstand in Washington durch den Parteienstreit. Die Solidität der Bilanzen der Emittenten vermittelt uns bei aller Ungewissheit ein gutes Gefühl, und aus unserer Sicht bietet die Anlageklasse Hochzinsanleihen Chancen aufgrund höherer Carry-Erträge und Aufwärtspotenzial bei den Kursen. Um diese Chancen zu nutzen, halten wir die Titelauswahl für entscheidend, da sich die Auswirkungen von höheren Kapitalkosten neben anderen Risiken über die gesamte Weltwirtschaft ausbreiten.

Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund

Die US-Notenbank (Fed) dürfte 2024 einige Zinssenkungen vornehmen, auch wenn der Preisdruck nicht stärker gegenüber seinem jüngsten Trend nachgibt. Sie werden aus unserer Sicht jedoch nicht das Ausmass haben, das der Markt zurzeit einpreist. Es besteht weiterhin erhebliche Ungewissheit, ob die Inflation 2024 eine Zinssenkung seitens der US-Notenbank von 150 Basispunkten zulassen wird, die der Markt für kurzfristige Zinsen zurzeit einpreist. Abgesehen davon besteht die Gefahr, dass im Zuge einer weiteren Konjunkturabkühlung gelegentlich mehr Kennzahlen auf eine Rezession statt auf eine sanfte Landung hindeuten. Vor allem zeigen sich andere bedeutende Wirtschaftsregionen ausserhalb der USA – etwa China und die Europäische Union – relativ kraftlos, was den breiter angelegten desinflationären Trend weiter verstärken dürfte. Eine schwache Nachfrage in diesen Volkswirtschaften hat in Verbindung mit genesenden Lieferketten zur Förderung der Deflation bei den weltweiten Preisen für Güter beigetragen. Wir glauben, dass die weltweite Inflation höher wäre und die Fed geringeren Spielraum hätte, um Zinssenkungen ins Auge zu fassen, wenn Europa und China in Top-Form wären. Die einzigen Märkte für inflationsgebundene Anleihen, die in den vergangenen zwölf Monaten eine positive Wertentwicklung verzeichnete, waren Japan (+2,7%), Italien (+1,9%) und Australien (+1,3%). Alle anderen inflationsgebundenen Anleihen haben in absoluten Zahlen abgegeben. Die schlechteste Wertentwicklung, gemessen am Barclays World Government Inflation-Linked Bonds Index (WGILB, lokale Rendite), verzeichnete das Vereinigte Königreich mit einem Verlust von satten -10,6%. Die meisten anderen wichtigen Märkte gaben zwischen 1% (USA) und 3% (Deutschland) nach. Relativ betrachtet (im Vergleich zu Nominalanleihen mit ähnlicher Laufzeit) schnitt Japan mit einer Outperformance von 4,1% am besten ab.

Der bedeutendste negative Performancebeitrag des Subfonds stammte von unserer Short-Positionierung in der realen Duration in den USA. Das synthetische Inflationsengagement über Unternehmensanleihen und Inflationsswaps war leicht positiv, da sich die Kreditspreads über den Berichtszeitraum verengten. Unter allgemeinen Durationsgesichtspunkten war der Subfonds ab April 2023 vorwiegend long positioniert, da wir in ein Umfeld steigender Zinsen verlängerten.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund

Der Berichtszeitraum wurde massiv beeinträchtigt von der anhaltenden Inflation in den ersten beiden Quartalen, Sorgen über die Widerstandsfähigkeit des Bankensystems nach dem Zusammenbruch einiger Regionalbanken in den USA und der Übernahme von Credit Suisse durch UBS und die ständigen Abschreibungen der Additional-Tier-1-Anleihen von Credit Suisse im März 2023 sowie von zunehmenden geopolitischen Spannungen im Nahen Osten zu Beginn des letzten Quartals 2023. US-Treasuries verloren über das ganze Jahr an Boden und die 10-jährige Rendite stieg zum Ende des 3. Quartals 2023 auf 4,93% und kletterte im September kurz über die 5%-Marke. Die Zentralbanken weltweit reagierten und nahmen eine drastische Anhebung ihrer Leitzinsen vor, was zu erhöhter Volatilität und negativen Renditen auf den Finanzmärkten führte. Sowohl die zinsensensitiven festverzinslichen Anlagen als auch der Aktienmarkt gerieten unter Druck.

Der Subfonds verzeichnete im Berichtszeitraum eine starke positive Wertentwicklung und schnitt insgesamt besser ab als die meisten festverzinslichen Marktsegmente, da er den Zinsanstieg und insbesondere die Zinsvolatilität aufgrund seines Ansatzes einer geringen Duration abfedern konnte und da er dank seines selektiven Kaufansatzes bei Schultiteln, die weniger anfällig für inflationsbedingten Margendruck sind, sowie dank seiner Anlagen im Crossover-Segment von der Verengung der Kreditspreads am Anleihenmarkt profitierte. Darüber hinaus profitierte der Fonds von einem aktiven Kreditmanagement und zunehmenden Diversifikationseffekten aufgrund seiner Flexibilität, in allen Sektoren des globalen Anleihenmarktes zu rotieren. Das Gesamtkreditrisiko des Portfolios, gemessen an der Spread-Duration, wurde im Jahr 2023 als Reaktion auf die allgemein schwächeren Marktbedingungen deutlich verringert. Darüber hinaus nahm der Fonds eine teilweise Umschichtung des Risikos in liquidere Instrumente vor, die von anhaltenden Zuflüssen aus sicheren Häfen profitieren dürften.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund

Geopolitische Spannungen beherrschten 2023 weiterhin die Schlagzeilen, wobei sich der Fokus zum Ende des Berichtszeitraums auf den Nahen Osten verlagerte. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hielt an, und die Zinsen stiegen in allen bedeutenden Währungen erheblich. Ein Lichtblick ist, dass die jüngsten Nachrichten und die Preisgestaltung bei Anleihen-Futures darauf hindeuten, dass der Markt davon ausgeht, dass die Zinsen ihren Spitzenwert erreicht haben, zumindest im aktuellen Zyklus. Nach dem markanten Abverkauf an den Aktienmärkten im vorangegangenen Berichtszeitraum wurden die Verluste in den vergangenen zwölf Monaten zum Teil wieder wettgemacht. Bei genauerem Hinsehen stellt man fest, dass sich die Erholung von Aktien nicht geradlinig vollzog, sondern einen holprigen Weg zurücklegte, auf dem Large Caps in der Regel besser abschnitten. Small Caps entwickelten sich deutlich schlechter, was kaum überraschend ist, da der grössere Teil ihrer Gewinne tendenziell erst weiter in der Zukunft anfällt. Bei festverzinslichen Anlagen waren gemischte Ergebnisse zu verzeichnen. Während engerer Kreditspreads hilfreich waren (und insbesondere Hochzinsstrategien und notleidenden Schuldtiteln zugutekamen), waren die höheren Zinsen es nicht. Vor diesem Hintergrund verzeichneten Wandelanleihen eine relativ gute Wertentwicklung.

Im Berichtszeitraum generierte der Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund eine Gesamtrendite von 5,8% (nach allen Kosten, in USD, nicht abgesichert, CSFSGBU LX Equity) gegenüber einer Rendite des Global Fixed Income von 1,72% (Bloomberg Global Agg – LEGATRUH Index). Somit konnte der Fonds den Gesamtmarkt übertreffen. Dies wurde durch die Allokation auf Anleihemärkten mit höherem Beta wie Hochzins- und Wandelanleihen sowie durch eine geringere Zinssensitivität getragen. Während des Berichtszeitraums wurde die Duration zu Zeiten steigender Zinsen verringert, lag aber am Ende mit einer modifizierten Duration von 2,8 auf demselben Niveau. Bei den Anleihen haben wir Investment-Grade- und High-Yield-Titel sowie auf Hartwährung lautende Unternehmensanleihen aus Schwellenländern zugunsten von Staatsanleihen und einer Aufstockung von Wandelanleihen reduziert, um von einem liquideren Profil und langfristiger Optionalität zu profitieren.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund

Das Geschäftsjahr bis zum 31. Oktober 2023 war positiv für hochverzinsliche Anlagen, da eine robuste US-Wirtschaft und günstige technische Marktbedingungen die anhaltende Straffung der finanziellen Bedingungen ausglich. Nach den erheblichen Zinsanhebungen im Jahr 2022 hofften die Marktteilnehmer auf eine Mässigung der Straffung durch die Zentralbanken im Jahr 2023. Anfang 2023 verbesserte sich die Anlegerstimmung erheblich und blieb im Allgemeinen das ganze Jahr über positiv, da die Inflationszahlen nachgaben und die Fed gemässigte Anpassungen an ihrer Politik vornahm. Wenngleich einige zinssensible und zyklische Bereiche der Wirtschaft Anzeichen eines Einbruchs erkennen liessen, konnten wir keine verbreiteten Hinweise auf eine Verschlechterung beobachten, und die Unternehmensbilanzen hielten sich relativ gut. Die Widerstandsfähigkeit der Wirtschaft insgesamt weckte Erwartungen von über längere Zeit höhere Zinsen, was zu einer Ausweitung des Zinsspreads von US-Treasuries um 88 Basispunkte über den Berichtszeitraum führte. Die technischen Faktoren auf dem Hochzinsmarkt waren günstig, insbesondere aufgrund einer Welle von "Rising Stars", d. h. Anleihen, die von High Yield auf Investment Grade heraufgestuft wurden, sowie aufgrund von moderaten Neuemissionen und einem hohen Niveau der Wiederanlage von Kupons. Kapitalzuflüsse von Investmentfonds waren hingegen schwach.

Im Geschäftsjahr zum 31. Oktober 2023 leistete die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen einen positiven Beitrag zur relativen Performance des Fonds gegenüber dem Index. Unter den Sektoren leisteten Grundstoffindustrie und Gesundheitswesen die besten Beiträge zur Performance. In der Grundstoffindustrie leisteten die Titelauswahl und eine Übergewichtung gegenüber der Benchmark einen positiven Beitrag zur Outperformance. Im Gesundheitssektor wirkte sich die Titelauswahl positiv auf die Performance aus. Freizeit und Energie belasteten hingegen die Wertentwicklung. In beiden Sektoren belasteten sowohl die Titelauswahl als auch eine Untergewichtung gegenüber der Benchmark die Performance. Unter Rating-Gesichtspunkten leistete das Segment Caa1 dank der Titelauswahl einen positiven Beitrag zur Performance, während Ba1 aufgrund der Titelauswahl für die Performance von Nachteil war.

Der Hochzinsmarkt hat sich nach dem Schock durch die Zinsanhebungen im Jahr 2022 stabilisiert. Während einige Inflationszahlen nachgeben, bleibt der Arbeitsmarkt angespannt, und wir gehen davon aus, dass höhere Löhne mittelfristig die Unternehmensgewinne belasten werden. Dennoch sind Emittenten von Hochzinsanleihen weitgehend in guter Verfassung und werden es nach unserer Einschätzung trotz möglicherweise für längere Zeit höherer Zinsen auch bleiben. Über die Inflation und Zinsrisiken hinaus bestehen weitere Gefahren, darunter zunehmende geopolitische Spannungen im Nahen Osten, schwächelnde Verbraucherausgaben in den USA und Stillstand in Washington durch den Parteienstreit. Die Solidität der Bilanzen der Emittenten vermittelt uns bei aller Ungewissheit ein gutes Gefühl, und aus unserer Sicht bietet die Anlageklasse Hochzinsanleihen Chancen aufgrund höherer Carry-Erträge und Aufwärtspotenzial bei den Kursen. Um diese Chancen zu nutzen, halten wir die Titelauswahl für entscheidend, da sich die Auswirkungen von höheren Kapitalkosten neben anderen Risiken über die gesamte Weltwirtschaft ausbreiten.

Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund

Der Berichtszeitraum wurde massiv beeinträchtigt von der anhaltenden Inflation in den ersten beiden Quartalen, Sorgen über die Widerstandsfähigkeit des Bankensystems nach dem Zusammenbruch einiger Regionalbanken in den USA und der Übernahme von Credit Suisse durch UBS und die ständigen Abschreibungen der Additional-Tier-1-Anleihen von Credit Suisse im März 2023 sowie von zunehmenden geopolitischen Spannungen im Nahen Osten zu Beginn des letzten Quartals 2023. US-Treasuries verloren über das ganze Jahr an Boden und die 10-jährige Rendite stieg zum Ende des 3. Quartals 2023 auf 4,93% und kletterte im September kurz über die 5%-Marke. Die Zentralbanken weltweit reagierten und nahmen eine drastische Anhebung ihrer Leitzinsen vor, was zu erhöhter Volatilität und negativen Renditen auf den Finanzmärkten führte. Sowohl die zinssensitiven festverzinslichen Anlagen als auch der Aktienmarkt gerieten unter Druck.

Der Subfonds verzeichnete über den Berichtszeitraum eine positive absolute Performance, was im Wesentlichen vom generierten Carry und der Positionierung in Anleihen getragen wurde, die von der Spreadverengung profitierten. Zinsen waren die grösste Belastung, was durch höhere Zinsen auf Staatsanleihen bedingt war. Die relative Performance wurde weitgehend durch die Zinsentwicklung bestimmt, die aufgrund der längeren Duration gegenüber der Benchmark einen negativen Einfluss hatte. Das Gesamtrisiko des Fonds in Bezug auf Anleihen (gemessen an der Spread-Duration) blieb über den Berichtszeitraum neutral, obwohl der Fonds weiterhin eine Übergewichtung in Schuldtiteln mit BBB-Rating und in nachrangigen Wertpapieren hatte, sodass er eine etwas aggressivere Positionierung als die Benchmark aufwies. Bei der Positionierung auf der Zinsseite wurde die Duration im zweiten Quartal 2023 langsam erhöht, sodass der Subfonds zum Ende des Berichtszeitraums im Vergleich zur Benchmark eine etwas längere Duration (+0,2 Jahre) aufwies.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund

2023 war ein schwieriges Jahr. Dies lag im Wesentlichen am ungewissen Marktumfeld, das durch eine mögliche Rezession in den USA, hohen Inflationszahlen und Ungewissheit bezüglich weiterer Zinsanhebungen durch die Fed in den USA. Aufgrund der Übernahme der Credit Suisse durch UBS verzeichnete der Fonds erhebliche Mittelabflüsse. Vor diesem Hintergrund stand immer eine bedarfsgerechte Liquidität zur Verfügung. Das Risikomanagement spielte eine zentrale Rolle und spiegelte sich immer im Fondsportfolio wider. Grundsätzlich hielten wir an unserer strategischen Positionierung fest, da wir fest an die Mittelwertrückkehr (Mean Reversion) glauben und dass man unverändert über einen gesamten Kreditzyklus investiert bleiben sollte. Wir haben einige Feinabstimmungen vorgenommen und die Allokation von Emittenten dort auf der Kreditkurve positioniert, wo am meisten relativer Wert zu finden ist. Strategisch belissen wir die Positionierung im Allgemeinen bei einer Übergewichtung im High-Yield-Segment.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund

Geopolitische Spannungen beherrschten 2023 weiterhin die Schlagzeilen, wobei sich der Fokus zum Ende des Berichtszeitraums auf den Nahen Osten verlagerte. Die Straffung der finanziellen Bedingungen hielt an, und die Zinsen stiegen in allen bedeutenden Währungen erheblich. Ein Lichtblick ist, dass die jüngsten Nachrichten und die Preisgestaltung bei Anleihen-Futures darauf hindeuten, dass der Markt davon ausgeht, dass die Zinsen ihren Spitzenwert erreicht haben, zumindest im aktuellen Zyklus. Nach dem markanten Abverkauf an den Aktienmärkten im vorangegangenen Berichtszeitraum wurden die Verluste in den vergangenen zwölf Monaten zum Teil wieder wettgemacht. Bei genauerem Hinsehen stellt man fest, dass sich die Erholung von Aktien nicht geradlinig vollzog, sondern einen holprigen Weg zurücklegte, auf dem Large Caps in der Regel besser abschnitten. Small Caps entwickelten sich deutlich schlechter, was kaum überraschend ist, da der grössere Teil ihrer Gewinne tendenziell erst weiter in der Zukunft anfällt (z. B. im Biotechnologiesektor). Bei festverzinslichen Anlagen waren gemischte Ergebnisse zu verzeichnen. Während engere Kreditspreads hilfreich waren (und insbesondere Hochzinsstrategien und notleidenden Schuldtiteln zugutekamen), waren die höheren Zinsen es nicht. Vor diesem Hintergrund verzeichneten Wandelanleihen eine relativ gute Wertentwicklung. Nach einem Zeitraum schwacher Aktivitäten auf dem Primärmarkt zogen die Emissionsvolumen 2023 wieder an, woran Wandelanleihen mit Investment-Grade-Rating einen rekordhohen Anteil hatten.

Im Berichtszeitraum verzeichnete der Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund eine Gesamtrendite von 2,15% (nach allen Kosten, in USD, nicht abgesichert, CSSGLFA LX Equity), verglichen mit einer negativen Rendite der Benchmark von 4,33%. So blieb der Fonds auf Nettobasis um 2,18% und unter Berücksichtigung der TER um 2% hinter der Benchmark zurück. Zwischen Oktober 2022 und Oktober 2023 sank das absolute Delta des Fonds leicht von 48,2% auf 44,7%, nachdem es Ende Februar 2023 auf fast 54% angestiegen war. Relativ betrachtet verzeichnete das Delta einen leichten Anstieg von 1,8% long zu Beginn des Berichtszeitraums auf 6,5% long am Ende des Berichtszeitraums. Die relative Outperformance wurde von unserer ausgeprägten Untergewichtung im Segment unterhalb von Investment Grade getragen, die zu Beginn des Berichtszeitraums bei 10,7% und zum Ende bei 4,1% lag. Wir gingen von einem Anstieg der Ausfälle aus, und obwohl dieser sich nicht einstellte, sind wir der Auffassung, dass sich das von den schwächsten Schuldtiteln gebotene Risiko-Rendite-Verhältnis über den gesamten Zyklus "höherer Zinsen" als schlechter erweisen wird.

Zu Beginn des neuen Berichtszeitraums ist die Anlageklasse unseres Erachtens bestens aufgestellt, um von dem aktuellen Umfeld zu profitieren. Gegenwärtig werden über 76% des Universums globaler Wandelanleihen mit einem Abschlag auf den Rücknahmekurs gehandelt. Dieser Anteil lag noch im Januar 2021 bei 20%. Die Endfälligkeitsrendite (2,63% im Oktober 2023) liegt auf ihrem höchsten Niveau seit 2009, während die Ausfallraten nach wie vor sehr niedrig sind, und die Emittenten von Wandelanleihen, von denen viele keine weiteren Schulden in ihren Bilanzen haben, nutzen proaktiv die Gelegenheit, ihre Wandelanleihen mit einem Abschlag zurückzukaufen. Neuemissionen stehen im Wettbewerb zu den Renditen und der Optionalität, die auf dem Sekundärmarkt zu haben sind, und werden zu zunehmend attraktiven Konditionen angeboten. Wir wären nicht überrascht, wenn es ein Comeback von "Breakeven"-Strukturen gäbe, da immer mehr Emittenten durch höhere Zinssätze gezwungen sind, sich dem Wandelanleihenmarkt zuzuwenden, um ihre bestehenden reinen Anleihen zu refinanzieren. Die anhaltende Korrektur der Aktien von Small Caps (der Russel 2000 verlor über den Berichtszeitraum 8,6%) hat zu einem Rückgang der Aktiensensitivität geführt. Ende Oktober 2023 betrug das Delta globaler Wandelanleihen zum ersten Mal seit 2009 40%, was ein weiterer Hinweis auf ihren defensiven Charakter ist. Aus unserer Sicht dürften die höheren Renditen und das defensive Profil der Anlageklasse in Verbindung mit wenig anspruchsvollen Bewertungen und den Gelegenheiten, die der Primärmarkt bietet, künftig für Anleger attraktiv sein.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund

Der Berichtszeitraum war von einem Andauern des Straffungszyklus in den USA gekennzeichnet, da die Inflation im Land und in den meisten Volkswirtschaften der Industrieländer weiterhin hoch war. Gleichzeitig erwiesen sich die US-Wirtschaft wie auch die Weltwirtschaft als widerstandsfähig und veranlassten die Zentralbanken dazu, an ihrer restriktiven Geldpolitik festzuhalten. Während des Berichtszeitraums hob die US-Notenbank Fed die Obergrenze ihres Leitzinses um 225 Basispunkte auf 5,5% an. Die Renditekurve von US-Treasuries verschob sich nach oben, wobei langlaufende Anleihen schlechter abschnitten als kurzlaufende. Gleichzeitig führen die Widerstandsfähigkeit der Weltwirtschaft und starke technische Faktoren zu einer Verengung der Kreditspreads.

Aufgrund der Positionierung in kurzen Laufzeiten verzeichnete der Subfonds eine positive Rendite über den Berichtszeitraum, was vom hohen Carry und sich verengenden Kreditspreads getragen wurde. Relativ betrachtet schnitt der Fonds vor Gebühren jedoch schlechter ab als sein Vergleichsindex. Über den Berichtszeitraum hielt der Fonds an einer leichten Übergewichtung seiner High-Yield-Allokation fest, während seine durchschnittliche Qualität unverändert blieb. Wir haben das Engagement in den Titeln mit den Ratings AA und A etwas verringert und die Allokation in Titeln mit den Ratings BBB und CCC erhöht. Unter regionalen Gesichtspunkten war die bedeutendste Veränderung die Aufstockung der Allokation in Europa, Asien und Afrika bei einer Reduzierung der Allokation in Südamerika. Wir haben auch das Engagement in Barmitteln und kurzlaufenden Staatstiteln mit AAA-Rating erhöht. Bei den Ländern ist der Fonds weiterhin gut diversifiziert, wobei das grösste Engagement in Emittenten aus Mexiko 9,7% ausmacht. Am Ende des Berichtszeitraums hatte der Fonds ein durchschnittliches Rating von BB+ bei einer Duration von 1,6.

Informationen über die vom Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale sind im Anhang dieses Berichts zu finden.

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund
(vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	USD	10670988	LU0458985982	1,20%	1,41%
EB - Thesaurierend	USD	43511278	LU1875412121	0,42%	0,60%
FB - Thesaurierend	USD	3449721	LU0324196665	0,42%	0,60%
IB - Thesaurierend	USD	34491659	LU1515062245	0,80%	1,02%
MBH - Thesaurierend	USD	40798264	LU1732803868	0,34%	0,52%
UB - Thesaurierend	USD	26349671	LU1144398358	0,90%	1,11%
BH - Thesaurierend	CHF	10670990	LU0458986014	1,20%	1,49%
EBH - Thesaurierend	CHF	43511317	LU1875412477	0,42%	0,68%
FBH - Thesaurierend	CHF	3449820	LU0324197556	0,42%	0,68%
IBH - Thesaurierend	CHF	34491657	LU1515062161	0,80%	1,09%
IBHP - Thesaurierend	CHF	34491653	LU1515061940	0,60%	0,89%
UBH - Thesaurierend	CHF	26349690	LU1144398432	0,90%	1,19%
BH - Thesaurierend	EUR	10670991	LU0458986105	1,20%	1,49%
CBH - Thesaurierend	EUR	35224423	LU1546464345	1,00%	2,19%
EAH - Ausschüttend	EUR	43511334	LU1875412717	0,42%	0,68%
EBH - Thesaurierend	EUR	43511320	LU1875412550	0,42%	0,68%
FBH - Thesaurierend	EUR	3449818	LU0324197390	0,42%	0,68%
IBH - Thesaurierend	EUR	24943198	LU1089177338	0,80%	1,10%
IBHP - Thesaurierend	EUR	34491656	LU1515062088	0,60%	0,90%
MAH - Ausschüttend	EUR	40798051	LU1732803272	0,34%	0,60%
UAH - Ausschüttend	EUR	38311087	LU1685862994	0,90%	1,19%
UBH - Thesaurierend	EUR	26349698	LU1144398515	0,90%	1,19%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	USD	2,33%	/	-9,40%	3,87%	12,10%
EB - Thesaurierend	USD	3,04%	/	-8,66%	4,74%	13,02%
FB - Thesaurierend	USD	3,04%	/	-8,65%	4,74%	13,01%
IB - Thesaurierend	USD	2,68%	/	-9,04%	4,30%	12,53%
MBH - Thesaurierend	USD	3,11%	/	-8,59%	4,81%	13,07%
UB - Thesaurierend	USD	2,60%	/	-9,12%	4,19%	12,44%
BH - Thesaurierend	CHF	-1,29%	/	-11,83%	2,62%	9,73%
EBH - Thesaurierend	CHF	-0,61%	/	-11,11%	3,47%	10,64%
FBH - Thesaurierend	CHF	-0,61%	/	-11,15%	3,46%	10,64%
IBH - Thesaurierend	CHF	-0,96%	/	-11,48%	3,03%	10,14%
IBHP - Thesaurierend	CHF	-0,79%	/	-11,30%	2,74%	8,79%
UBH - Thesaurierend	CHF	-1,05%	/	-11,56%	2,91%	10,05%
BH - Thesaurierend	EUR	0,29%	/	-11,60%	2,82%	9,91%
CBH - Thesaurierend	EUR	-0,30%	/	-12,21%	2,11%	9,14%
EAH - Ausschüttend	EUR	0,98%	/	-10,87%	3,67%	10,81%
EBH - Thesaurierend	EUR	0,98%	/	-10,86%	3,68%	10,78%
FBH - Thesaurierend	EUR	0,98%	/	-10,87%	3,66%	10,85%
IBH - Thesaurierend	EUR	0,59%	/	-11,24%	3,23%	10,35%
IBHP - Thesaurierend	EUR	0,82%	/	-11,06%	2,92%	8,85%
MAH - Ausschüttend	EUR	1,05%	/	-10,80%	3,74%	10,87%
UAH - Ausschüttend	EUR	0,54%	/	-11,33%	3,15%	10,25%
UBH - Thesaurierend	EUR	0,55%	/	-11,34%	3,13%	10,24%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In USD)
USD	8.992	EUR	-8.500	09.11.2023	4,00
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund
(vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)**Technische Daten und Erläuterungen (Fortsetzung)****Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	262.472	CHF	-238.600	09.11.2023	50,00
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	251.405	EUR	-237.600	09.11.2023	169,59
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	23.826	CHF	-21.300	09.11.2023	398,94
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	7.506	CHF	-6.700	09.11.2023	136,77
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	768.000	USD	-814.191	09.11.2023	-2.116,61
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	76.900	USD	-81.771	09.11.2023	-457,63
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	382.100	USD	-404.306	09.11.2023	-278,02
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	400	USD	-423	09.11.2023	-0,03
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.392.320	EUR	-1.319.800	09.11.2023	-3.219,14
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	15.000	USD	-16.644	09.11.2023	-146,24
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	137.660	CHF	-123.600	09.11.2023	1.717,63
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	17.300	USD	-18.240	09.11.2023	52,68
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	79.301	EUR	-74.900	09.11.2023	102,72
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	210.886	CHF	-188.000	09.11.2023	4.111,77
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	584.560	EUR	-551.700	09.11.2023	1.198,41
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	38.983	CHF	-34.900	09.11.2023	597,69
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	72.426	CHF	-64.900	09.11.2023	1.045,02
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	78.967.100	USD	-83.360.995	09.11.2023	137.868,66
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	138.484.100	USD	-152.247.335	09.11.2023	63.155,80
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	78.029.800	USD	-82.615.034	24.11.2023	-56.150,25
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	138.119.500	USD	-155.541.028	24.11.2023	-3.391.487,74
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	6.444.894	JPY	-950.000.000	08.12.2023	132.964,77
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.017.615	JPY	-150.000.000	08.12.2023	20.994,44
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	6.697.502	JPY	-974.000.000	08.12.2023	225.569,54
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	44.874.640	JPY	-6.526.000.000	08.12.2023	1.511.362,26
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	287.002.165	EUR	-267.200.000	08.12.2023	4.098.193,42
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>					
USD	8.477.622	CHF	-7.500.000	08.12.2023	201.954,97
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

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

Käufe	Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung	
<i>Gegenpartei</i>				(In USD)	
USD	19.313.297	HKD	-151.000.000	08.12.2023	1.944,02
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften				2.949.737,44	

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund
(vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		716.218.058,19			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		25.781.515,96			
Forderungen aus Erträgen		1.960.591,07			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		2.949.737,44			
Andere Aktiva		143,80			
		746.910.046,46			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		443.760,11			
		443.760,11			
Nettovermögen		746.466.286,35			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	746.466.286,35	1.005.757.553,56	2.151.818.035,62	
Nettoinventarwert pro Aktie					
B - Thesaurierend	USD	142,97	138,55	153,36	
EB - Thesaurierend	USD	121,71	116,98	128,43	
FB - Thesaurierend	USD	188,76	181,43	199,17	
IB - Thesaurierend	USD	115,53	111,51	122,94	
MBH - Thesaurierend	USD	1.216,32	1.168,15	1.281,45	
UB - Thesaurierend	USD	133,16	128,64	141,97	
BH - Thesaurierend	CHF	113,86	115,29	130,39	
EBH - Thesaurierend	CHF	101,98	102,42	114,88	
FBH - Thesaurierend	CHF	146,22	146,85	164,79	
IBH - Thesaurierend	CHF	107,81	108,73	122,47	
IBHP - Thesaurierend	CHF	106,30	106,99	120,38	
UBH - Thesaurierend	CHF	106,94	107,96	121,73	
BH - Thesaurierend	EUR	119,73	119,07	134,55	
CBH - Thesaurierend	EUR	100,45	100,60	114,49	
EAH - Ausschüttend	EUR	105,15	103,72	116,25	
EBH - Thesaurierend	EUR	105,39	103,94	116,49	
FBH - Thesaurierend	EUR	156,44	154,32	172,95	
IBH - Thesaurierend	EUR	1.174,64	1.163,90	1.309,92	
IBHP - Thesaurierend	EUR	109,79	108,51	121,99	
MAH - Ausschüttend	EUR	1.055,61	1.040,43	1.165,13	
UAH - Ausschüttend	EUR	104,03	103,15	116,19	
UBH - Thesaurierend	EUR	111,90	110,96	125,01	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	USD	76.152,342	136.253,329	14.409,330	74.510,317
EB - Thesaurierend	USD	254.710,054	405.608,983	201.678,010	352.576,939
FB - Thesaurierend	USD	271.205,565	372.110,286	34.856,704	135.761,425
IB - Thesaurierend	USD	15.079,406	88.537,187	56.387,219	129.845,000
MBH - Thesaurierend	USD	142.990,059	152.145,159	0,000	9.155,100
UB - Thesaurierend	USD	93.777,745	123.097,375	539,248	29.858,878
BH - Thesaurierend	CHF	36.223,707	59.959,279	623,520	24.359,092
EBH - Thesaurierend	CHF	1.760.178,922	2.146.431,605	111.441,469	497.694,152
FBH - Thesaurierend	CHF	226.073,827	263.579,550	24.884,119	62.389,842

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
IBH - Thesaurierend	CHF	166.439,666	202.860,911	0,000	36.421,245
IBHP - Thesaurierend	CHF	95.545,387	103.325,952	0,000	7.780,565
UBH - Thesaurierend	CHF	274.061,813	620.888,169	5.488,921	352.315,277
BH - Thesaurierend	EUR	138.622,081	186.402,197	14.992,969	62.773,085
CBH - Thesaurierend	EUR	618,836	2.542,182	0,000	1.923,346
EAH - Ausschüttend	EUR	308.716,719	352.958,538	945,000	45.186,819
EBH - Thesaurierend	EUR	43.267,359	45.948,371	35.242,182	37.923,194
FBH - Thesaurierend	EUR	199.590,669	250.567,741	77.467,710	128.444,782
IBH - Thesaurierend	EUR	5.847,365	63.040,976	3.152,000	60.345,611
IBHP - Thesaurierend	EUR	11.504,909	26.190,336	0,000	14.685,427
MAH - Ausschüttend	EUR	48.196,683	103.499,391	4.717,292	60.020,000
UAH - Ausschüttend	EUR	9.383,835	9.927,670	1.673,225	2.217,060
UBH - Thesaurierend	EUR	92.198,750	174.009,307	2.968,810	84.779,367

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	1.005.757.553,56
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	5.837.994,80
Dividenden (Netto)	555.252,19
Bankzinsen	687.609,46
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	677.459,10
	7.758.315,55
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	4.530.797,97
Depotbank- und Depotgebühr	517.068,18
Zentralverwaltungsvergütung	630.598,08
Druck- und Veröffentlichungskosten	56.656,79
Zinsen und Bankspesen	23.849,02
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a. *	797.741,77
"Taxe d'abonnement"	155.689,75
	6.712.401,56
Nettoerträge (-verluste)	1.045.913,99
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-30.079.746,04
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	48.409.051,86
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	1.789.735,13
	20.119.040,95
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	21.164.954,94
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	89.578.137,50
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-33.516.212,49
	56.061.925,01
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	77.226.879,95
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	16.591.678,60
Rücknahmen	-353.109.825,76
	-336.518.147,16
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	746.466.286,35

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Kosten für Absicherung und Berichterstattung gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	29,77
Frankreich	13,51
Niederlande	7,55
Japan	6,94
Südkorea	6,63
Kaimaninseln	4,79
Italien	3,71
Spanien	3,46
Deutschland	2,75
Hongkong	2,71
Luxemburg	2,16
Britische Jungfernseln	2,07
Belgien	1,99
Schweden	1,90
Indien	1,41
Schweiz	1,05
Kanada	0,92
Singapur	0,70
Grossbritannien	0,54
China	0,43
Neuseeland	0,35
Österreich	0,33
Bermudas	0,27
Total	95,95

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	20,44
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	14,65
Energie- und Wasserversorgung	7,92
Elektronik und Halbleiter	7,55
Immobilien	6,62
Banken und andere Kreditinstitute	5,43
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	5,23
Petroleum	4,38
Chemie	3,89
Luft- und Raumfahrtindustrie	3,75
Verkehr und Transport	2,77
Computerhardware und Netzwerk	2,25
Fahrzeuge	1,81
Telekommunikation	1,41
Gummi und Reifen	1,34
Elektrische Geräte und Komponenten	1,27
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,14
Edelmetalle und Edelsteine	0,92
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	0,82
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,78
Anlagefonds	0,54
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,47
Tabak und alkoholische Getränke	0,30
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,28
Total	95,95

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
USD EQT CORP	115.000	4.873.700,00	0,65
Total Aktien		4.873.700,00	0,65
Anleihen			
USD AAON SEMICONDUCTOR CORP CV 0.5%/23-01032	3.000.000	2.637.390,00	0,35
USD AKAMAI TECH 144A 1.125%/23-150229	26.000.000	25.597.260,00	3,43
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC CV 0.375%/19-010927	8.000.000	8.149.360,00	1,09
USD ALLIANT ENERGY CORP CV 3.875%/23-150326	7.500.000	7.330.650,00	0,98
USD ALNYLAM PHARM 1%/22-150927	2.000.000	1.735.720,00	0,23
EUR AMADEUS IT GROUP SA CV 1.5%/20-090425	10.000.000	11.646.448,80	1,56
EUR AMERICA MOVIL BV CV 0%/21-020324	24.000.000	26.260.699,92	3,52
USD AMERICAN WATER C CV 3.625%/23-150626	4.000.000	3.851.040,00	0,52
JPY ANA HOLDINGS INC CV 0%/21-101231	400.000.000	2.921.429,58	0,39
USD ARES CAPITAL CORP CV 4.625%/19-010324	4.000.000	4.035.080,00	0,54
USD BANK OF AMERICA CORP S L CV 7.25%/PERPET	5.000	5.288.175,00	0,71
EUR BARCLAYS BANK PLC CV 0%/22-240125	4.000.000	4.056.174,08	0,54
USD BENTLEY SYSTEMS CV 0.375%/21-010727	3.000.000	2.549.250,00	0,34
USD BHARTI AIRTEL LTD CV 1.5%/20-170225	7.000.000	10.497.970,00	1,41
EUR BNP PARIBAS CV 0%/22-130625	5.000.000	5.822.273,10	0,78
USD BOOKING HOLDINGS INC CV 0.75%/20-010525	10.000.000	15.249.100,00	2,04
USD BOSIDENG INTERNATIONAL CV 1%/19-171224	6.000.000	5.803.440,00	0,78
HKD CATHAY PACIFIC FIN III 2.75%/21-050226	16.000.000	2.078.798,19	0,28
CHF CEMBRA MONEY BANK AG CV 0%/19-090726	1.400.000	1.435.265,24	0,19
USD CIE GEN ETABLIS MICHELIN CV 0%/18-101123	10.000.000	9.984.600,00	1,34
HKD CITIGROUP GLOB MK L S960 CV 0%/20-250724	40.000.000	4.886.283,03	0,65
EUR CITIGROUP GLOB MKT FND L CV 0%/23-150328	2.000.000	2.180.421,88	0,29
USD CMS ENERGY CORP 3.375%/23-010528	15.000.000	14.202.600,00	1,90
EUR DEUTSCHE POST AG CV 0.05%/17-300625	8.000.000	7.949.316,48	1,06
USD DEXCOM INC CV 144A 0.375%/23-150528	2.800.000	2.469.768,00	0,33
USD DUKE ENERGY CORP CV 4.125%/23-150426	20.000.000	19.479.800,00	2,61
EUR EDENRED CV 0%/21-140628	180.000	11.893.913,64	1,59
USD ENVISTA HOLDINGS 1.75%/23-150828	5.000.000	4.326.150,00	0,58
USD EQT CORP CV 1.75%/20-010526	2.700.000	7.849.980,00	1,05
EUR FASTIGHETS AB BALDER CV 3.5%/23-230228	8.000.000	7.670.183,92	1,03
USD FIRST MAJESTIC SILV CV 0.375%/21-150127	4.000.000	3.017.800,00	0,40
USD FORD MOTOR COMPANY CV 0%/21-150326	9.000.000	8.215.290,00	1,10
EUR GEELY SWEDEN FINANCE AB CV 0%/19-190624	4.500.000	6.546.133,13	0,88
EUR GRP BRUXELLES SA CV 2.125%/22-291125	8.000.000	8.162.069,44	1,09
USD HAT HOLDINGS I LLC/HAT 3.75%/23-150828	5.000.000	4.361.700,00	0,58
EUR IBERDROLA S IBE CV 0.8%/22-071227	7.000.000	7.168.299,18	0,96
EUR INTL CONSOLIDATED CV 1.125%/21-180528	8.000.000	6.992.858,32	0,94
USD JAZZ INVESTMENTS I LTD CV 2%/20-150626	2.000.000	2.030.460,00	0,27
JPY JFE HOLDINGS INC CV 0%/23-280928	1.500.000.000	10.257.682,07	1,37
EUR JP MORGAN CHASE BANK NA CV 0%/21-100624	5.000.000	5.319.352,50	0,71
EUR JPMORGAN CHASE CV 0%/22-140125	4.000.000	4.226.816,16	0,57
EUR JPMORGAN CHASE CV 0%/22-290425	4.500.000	5.097.826,44	0,68
EUR LAGFIN SCA CV 3.5%/23-080628	1.700.000	1.710.576,92	0,23
EUR LEG IMMOBILIEN AG CV 0.4%/20-300628	10.000.000	8.183.716,80	1,10
USD LENOVO GROUP LTD CV 2.5%/22-260829	14.000.000	16.798.320,00	2,25
USD LG CHEM LTD CV 1.25%/23-180728	16.000.000	15.038.560,00	2,01
USD LG CHEM LTD CV 1.6%/23-180730	10.000.000	9.075.400,00	1,22
HKD LINK CB LTD CV 4.5%/22-121227	60.000.000	7.528.105,68	1,01
USD LIVE NATION ENTERTAI CV 3.125%/23-150129	1.800.000	1.813.788,00	0,24
USD MARRIOTT CV 144A 3.25%/22-151227	2.000.000	1.695.740,00	0,23
USD MEITUAN CV/21-270428	27.000.000	22.542.840,00	3,02
EUR MERRILL LYNCH BV CV 0%/23-300126	4.000.000	4.423.587,28	0,59
USD MGP INGREDIENTS INC CV 1.875%/21-151141	2.000.000	2.265.820,00	0,30
EUR MONDELEZ INTL HLDINGS NE CV 0%/21-200924	6.000.000	6.107.282,58	0,82
JPY NIPPON STEEL CORP CV 0%/21-041024	150.000.000	1.336.980,13	0,18
JPY NIPPON STEEL CORP CV 0%/21-051026	4.000.000.000	35.264.543,78	4,72
EUR OLIVER CAPITAL SARL CV 0%/20-291223	7.000.000	7.342.249,67	0,98
USD PIONEER NATURAL RESOURCE CV 0.25%/20-150525	7.300.000	18.629.454,00	2,50
EUR PIRELLI & C SPA CV 0%/20-221225	5.000.000	4.934.128,85	0,66
EUR PRYSMIAN SPA CV 0%/21-020226	8.000.000	8.689.385,60	1,16
EUR SAFRAN SA CV 0%/21-010428	60.000	11.242.273,14	1,51
EUR SAFRAN SA CV 0.875%/20-150527	130.000	20.974.674,63	2,81
EUR SAGERPAR CV 0%/21-010426	7.000.000	6.665.537,13	0,89
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE CV 0%/20-150626	50.000	9.456.820,45	1,27
EUR SGX TREASURY I PTE LTD CV 0%/21-010324	5.000.000	5.215.079,45	0,70
USD SK HYNIX INC CV 1.75%/23-110430	21.000.000	25.409.160,00	3,40
USD SOUTHERN CO CV 144A 3.875%/23-151225	16.500.000	16.210.755,00	2,17
USD SOUTHWEST AIRLINES CO CV 1.25%/20-010525	10.000.000	9.530.000,00	1,28
EUR SPIE SA CV 2%/23-170128	2.400.000	2.452.273,82	0,33
USD SSR MINING INC CV 2.5%/19-010439	3.700.000	3.837.899,00	0,51
USD STMICROELECTRONICS NV S B CV 0%/040827	19.000.000	19.596.220,00	2,63
CHF SWISS PRIME SITE AG CV 0.325%/18-160125	6.000.000	6.431.333,23	0,86
EUR TAG IMMOBILIEN AG CV 0.625%/20-270826	5.000.000	4.386.338,60	0,59
EUR UBISOFT ENTERTAINMNT CV 2.375%/22-151128	2.000.000	2.187.609,48	0,29
USD UNIVERSE TREK LTD CV 0%/21-150626	8.000.000	7.939.600,00	1,06
USD VENTAS REALTY LP CV 3.75%/23-010626	5.000.000	4.925.050,00	0,66
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA CV 0%/19-010125	150.000	4.789.478,40	0,64
EUR VOESTALPINE AG CV 2.75%/23-280428	2.500.000	2.431.522,80	0,33
USD WELLTOWER CV 144A 2.75%/23-150528	10.000.000	10.273.300,00	1,38
EUR WENDEL SE CV 2.625%/23-270326	4.000.000	4.047.760,36	0,54
EUR WORLDLINE SA/FRANCE CV 0%/19-30.07.2026	195.000	18.000.229,07	2,41
USD XERO INVESTMENTS LTD CV 0%/20-021225	3.000.000	2.617.710,00	0,35
USD XIAOMI BEST TIME INTL CV 0%/20-171227	4.000.000	3.464.320,00	0,46

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

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund
(vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettövermö- gens
EUR ZHEJIANG EXPRESSWAY CO CV 0%/21-200126	3.000.000	3.220.309,05	0,43
HKD ZHONGSHENG GROUP CV 0%/20-210525	40.000.000	5.321.525,84	0,71
Total Anleihen		695.242.086,84	93,14
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
		700.115.786,84	93,79
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
JPY DAIFUKU CO CV 0%/23-130930	300.000.000	2.055.121,87	0,28
EUR ENI SPA CV 0%/23-140930	13.000.000	14.047.149,48	1,88
Total Anleihen		16.102.271,35	2,16
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
		16.102.271,35	2,16
Total des Wertpapierbestandes		716.218.058,19	95,95
Bareinlagen bei Banken und Brokern		25.781.515,96	3,45
Andere Nettowertmögenswerte		4.466.712,20	0,60
Teilfondsvermögen		746.466.286,35	100,00

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

Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
EA - Ausschüttend	EUR	48071882	LU2001707095	0,40%	0,59%
EB - Thesaurierend	EUR	26495906	LU1160527336	0,40%	0,59%
IA - Ausschüttend	EUR	48071884	LU2001706444	0,50%	0,73%
IB - Thesaurierend	EUR	26493403	LU1160526791	0,50%	0,73%
MB - Thesaurierend	EUR	31143113	LU1348933547	0,25%	0,44%
QB - Thesaurierend	EUR	26495929	LU1160527849	1,00%	1,23%
DBH - Thesaurierend	CHF	27433640	LU1203073041	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	CHF	26495909	LU1160527500	0,40%	0,67%
QBH - Thesaurierend	CHF	26495932	LU1160528144	1,00%	1,31%
IAH - Ausschüttend	GBP	49857194	LU2050655047	0,50%	0,81%
UAH - Ausschüttend	GBP	49150509	LU2034323647	0,50%	/
DAH - Ausschüttend	USD	49408615	LU2039695205	0,00%	0,15%
DBH - Thesaurierend	USD	28325639	LU1238154758	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	USD	26495920	LU1160527682	0,40%	0,68%
IAH - Ausschüttend	USD	48073327	LU2001707251	0,50%	0,81%
IBH - Thesaurierend	USD	26495435	LU1160527252	0,50%	0,81%
QAH - Ausschüttend	USD	48073284	LU2001707509	1,00%	1,31%
QBH - Thesaurierend	USD	26495939	LU1160528490	1,00%	1,31%
UAH - Ausschüttend	USD	49133934	LU2034323217	0,50%	0,81%

Für die Aktienklassen -DAH- und -DBH- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund -UAH- GBP wurde am 28.02.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
EA - Ausschüttend	EUR	-0,16%	/	-10,82%	4,59%	4,24%
EB - Thesaurierend	EUR	-0,16%	/	-10,82%	4,59%	4,24%
IA - Ausschüttend	EUR	-0,27%	/	-10,95%	4,44%	4,07%
IB - Thesaurierend	EUR	-0,27%	/	-10,95%	4,44%	4,10%
MB - Thesaurierend	EUR	-0,04%	-5,57%	-10,69%	4,74%	/
QB - Thesaurierend	EUR	-0,69%	/	-11,39%	3,92%	3,57%
DBH - Thesaurierend	CHF	-1,30%	/	-10,85%	4,84%	4,44%
EBH - Thesaurierend	CHF	-1,76%	/	-11,30%	4,32%	3,92%
QBH - Thesaurierend	CHF	-2,28%	/	-11,85%	3,66%	3,26%
IAH - Ausschüttend	GBP	0,95%	/	-9,81%	5,00%	3,49%
UAH - Ausschüttend	GBP	/	/	-9,86%	5,00%	/
DAH - Ausschüttend	USD	2,13%	/	-8,29%	5,91%	6,80%
DBH - Thesaurierend	USD	2,13%	/	-8,33%	5,89%	6,89%
EBH - Thesaurierend	USD	1,66%	/	-8,79%	5,36%	6,36%
IAH - Ausschüttend	USD	1,55%	/	-8,88%	5,02%	6,08%
IBH - Thesaurierend	USD	1,54%	/	-8,91%	5,22%	6,17%
QAH - Ausschüttend	USD	1,12%	/	-9,33%	4,50%	5,59%
QBH - Thesaurierend	USD	1,12%	/	-9,37%	4,69%	5,68%
UAH - Ausschüttend	USD	1,54%	4,48%	-8,88%	5,24%	/

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
EA - Ausschüttend	EUR	06.12.2022	11,71
EA - Ausschüttend	EUR	07.03.2023	11,54
EA - Ausschüttend	EUR	06.06.2023	11,32
EA - Ausschüttend	EUR	05.09.2023	13,23
IA - Ausschüttend	EUR	06.12.2022	11,71
IA - Ausschüttend	EUR	07.03.2023	11,52
IA - Ausschüttend	EUR	06.06.2023	11,34
IA - Ausschüttend	EUR	05.09.2023	13,27
IAH - Ausschüttend	GBP	06.12.2022	15,38
IAH - Ausschüttend	GBP	07.03.2023	14,46
IAH - Ausschüttend	GBP	06.06.2023	13,65
IAH - Ausschüttend	GBP	05.09.2023	15,49
UAH - Ausschüttend	GBP	06.12.2023	1,54
UAH - Ausschüttend	GBP	07.03.2023	1,45
DAH - Ausschüttend	USD	06.12.2022	19,23
DAH - Ausschüttend	USD	07.03.2023	19,49
DAH - Ausschüttend	USD	06.06.2023	17,86
DAH - Ausschüttend	USD	05.09.2023	18,81
IAH - Ausschüttend	USD	06.12.2022	17,99

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

IAH - Ausschüttend	USD	07.03.2023	18,25
IAH - Ausschüttend	USD	06.06.2023	16,63
IAH - Ausschüttend	USD	05.09.2023	17,56
QAH - Ausschüttend	USD	06.12.2022	16,21
QAH - Ausschüttend	USD	07.03.2023	16,42
QAH - Ausschüttend	USD	06.06.2023	14,96
QAH - Ausschüttend	USD	05.09.2023	15,81
UAH - Ausschüttend	USD	06.12.2022	1,73
UAH - Ausschüttend	USD	07.03.2023	1,76
UAH - Ausschüttend	USD	06.06.2023	1,59
UAH - Ausschüttend	USD	05.09.2023	1,70

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
Gegenpartei					
USD	2.200.000	EUR	-2.087.510	08.11.2023	-6.827,11
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	2.200.000	EUR	-2.538.198	08.11.2023	-13.224,15
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	1.300.000	EUR	-1.234.190	08.11.2023	-4.694,97
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
GBP	3.700.000	EUR	-4.321.656	08.11.2023	-75.108,78
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	300.000	EUR	-279.019	08.11.2023	4.710,09
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	7.260.572	CHF	-6.900.000	08.11.2023	83.966,62
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	61.320.401	GBP	-52.400.000	08.11.2023	1.180.437,97
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>					
EUR	459.454	GBP	-400.000	08.11.2023	368,18
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	340.000	EUR	-393.305	08.11.2023	-3.081,27
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	250.000	EUR	-236.859	08.11.2023	-417,78
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.560.890	08.11.2023	-768,05
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	300.000	EUR	-283.518	08.11.2023	211,56
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	5.300.000	EUR	-6.107.550	08.11.2023	-24.656,94
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	45.161.215	USD	-49.100.000	08.11.2023	-1.276.267,90
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>					
EUR	492.374	USD	-520.700	09.11.2023	-66,15
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	73.698.700	EUR	-69.785.479	09.11.2023	-86.655,36
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	5.142.600	EUR	-5.353.625	09.11.2023	-4.556,76
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	33.190	USD	-35.000	09.11.2023	89,99
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	349.397	USD	-370.400	09.11.2023	-900,10
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	187.991	USD	-199.900	09.11.2023	-1.059,83
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					<i>(In EUR)</i>
EUR	88.500	USD	-93.800	09.11.2023	-209,32
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.028.000	EUR	-970.380	09.11.2023	1.827,17
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	2.483.400	EUR	-2.869.523	09.11.2023	-19.387,54
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	74.206.000	EUR	-70.003.877	24.11.2023	131.268,48
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	4.992.900	EUR	-5.303.674	24.11.2023	-105.324,93
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	2.442.600	EUR	-2.794.894	24.11.2023	6.928,00
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-213.398,88

Swapkontrakte

Art		Verbindlichkeiten			Forderungen		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>		<i>Nennwert</i>			<i>Nennwert</i>			<i>(in EUR)</i>
IRS	GBP	10.000.000	3.4926	GBP	10.000.000	1D/GBP-SONIA-OIS-COMPOUND	30/08/2026	416.826,04
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	30.000.000	3.5232	EUR	30.000.000	6M / EURIBOR	02/03/2027	-694.735,65
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	15.000.000	2.2997	EUR	15.000.000	6M / EURIBOR	01/09/2029	791.744,86
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten								513.835,25

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

	31.10.2023
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	305.559.106,84
Bareinlagen bei Banken und Brokern	15.592.864,96
Forderungen aus Erträgen	4.879.956,54
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten	513.835,25
Andere Aktiva	680,52
	326.546.444,11
Passiva	
Bankverbindlichkeiten und sonstige	552.158,04
Rückstellungen für Aufwendungen	151.871,73
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	213.398,88
	917.428,65
Nettovermögen	325.629.015,46

Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Teilfondsvermögen	EUR	325.629.015,46	520.463.149,84	1.030.628.802,08
Nettoinventarwert pro Aktie				
EA - Ausschüttend	EUR	843,28	850,23	1.047,81
EB - Thesaurierend	EUR	1.119,50	1.068,39	1.254,38
IA - Ausschüttend	EUR	865,04	872,19	1.074,80
IB - Thesaurierend	EUR	1.046,63	1.000,20	1.175,95
MB - Thesaurierend	EUR	944,28	899,83	1.054,89
QB - Thesaurierend	EUR	1.269,27	1.219,04	1.440,45
DBH - Thesaurierend	CHF	1.006,14	973,10	1.140,11
EBH - Thesaurierend	CHF	991,35	964,06	1.135,37
QBH - Thesaurierend	CHF	1.198,52	1.172,96	1.390,06
IAH - Ausschüttend	GBP	830,36	837,76	1.033,17
UAH - Ausschüttend	GBP	/	83,98	103,55
DAH - Ausschüttend	USD	866,26	871,98	1.068,83
DBH - Thesaurierend	USD	1.581,81	1.463,62	1.681,45
EBH - Thesaurierend	USD	1.105,68	1.028,67	1.187,70
IAH - Ausschüttend	USD	880,27	886,09	1.086,27
IBH - Thesaurierend	USD	1.136,15	1.058,46	1.223,81
QAH - Ausschüttend	USD	847,70	853,26	1.046,03
QBH - Thesaurierend	USD	1.483,06	1.388,56	1.613,53
UAH - Ausschüttend	USD	84,90	85,46	104,74

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
EA - Ausschüttend	EUR	13.203,506	24.107,541	30,000	10.934,035
EB - Thesaurierend	EUR	18.721,638	36.190,972	1.299,257	18.768,591
IA - Ausschüttend	EUR	23.336,546	33.509,028	427,482	10.599,964
IB - Thesaurierend	EUR	47.342,697	78.688,339	28.786,679	60.132,321
MB - Thesaurierend	EUR	60.885,855	91.903,937	520,506	31.538,588
QB - Thesaurierend	EUR	6.919,613	15.337,738	1.113,260	9.531,385
DBH - Thesaurierend	CHF	2.880,000	3.111,623	37,000	268,623
EBH - Thesaurierend	CHF	4.603,791	7.681,791	1.255,000	4.333,000
QBH - Thesaurierend	CHF	2.302,169	2.703,931	0,000	401,762
IAH - Ausschüttend	GBP	5.997,180	7.241,563	243,034	1.487,417
UAH - Ausschüttend	GBP	0,000	1.338,742	0,000	1.338,742
DAH - Ausschüttend	USD	12.000,000	13.278,931	184,368	1.463,299

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung (Fortsetzung)

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
DBH - Thesaurierend	USD	45.242,911	58.481,547	2.142,215	15.380,851
EBH - Thesaurierend	USD	1.050,000	12.672,855	0,000	11.622,855
IAH - Ausschüttend	USD	32.568,509	54.800,116	2.140,646	24.372,253
IBH - Thesaurierend	USD	18.799,774	38.428,612	3.667,077	23.295,915
QAH - Ausschüttend	USD	9.773,956	12.627,403	498,561	3.352,008
QBH - Thesaurierend	USD	4.816,588	11.891,181	1.427,315	8.501,908
UAH - Ausschüttend	USD	7.630,450	18.733,606	3.450,000	14.553,156

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in EUR)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	520.463.149,84
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	26.006.010,63
Bankzinsen	434.044,10
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	219.415,28
Andere Erträge	327.250,00
	26.986.720,01
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.760.538,97
Depotbank- und Depotgebühr	249.752,39
Zentralverwaltungsvergütung	241.686,35
Druck- und Veröffentlichungskosten	31.522,11
Zinsen und Bankspesen	672,98
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a. *	331.869,29
"Taxe d'abonnement"	108.502,86
	2.724.544,95
Nettoerträge (-verluste)	24.262.175,06
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-52.056.879,85
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	10.591.115,88
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-14.824.381,69
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	1.534.172,53
	-54.755.973,13
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-30.493.798,07
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	40.453.179,49
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-9.616.529,34
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	7.462.551,36
	38.299.201,51
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	7.805.403,44
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	46.826.407,20
Rücknahmen	-242.026.613,43
	-195.200.206,23
Ausschüttung	-7.439.331,59
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	325.629.015,46

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Kosten für Absicherung und Broker gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Grossbritannien	15,74
Niederlande	13,03
Frankreich	11,05
Deutschland	10,05
Spanien	9,73
Italien	6,91
Österreich	6,35
Irland	4,96
Schweiz	4,76
Belgien	3,28
Dänemark	3,10
Schweden	2,29
Finnland	1,91
Portugal	0,68
Total	93,84

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	79,31
Versicherungsgesellschaften	6,36
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	6,19
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	1,98
Total	93,84

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
EUR ABN AMRO BANK NV FF 17-PERPET	9.000.000	7.542.000,00	2,32
EUR ACHMEA BV SUB FF FRN/19-PERPET	6.000.000	4.575.300,00	1,41
EUR AEGON NV SUB FF FRN/19-PERPET	5.000.000	4.366.050,00	1,34
EUR AGEAS FINANCE NV SUB FF FRN/19-PERPET	6.000.000	4.296.580,00	1,32
EUR AIB GROUP PLC SUB FF FRN/19-PERPET	3.000.000	2.875.470,00	0,88
EUR AIB GROUP PLC SUB FF FRN/20-PERPET	2.400.000	2.298.912,00	0,70
EUR ALLIANZ SE SUB FF FRN/20-PERPET	4.000.000	2.719.760,00	0,84
EUR ASR NEDERLAND FF 4,625%/17-PERPET	6.000.000	4.914.960,00	1,51
EUR BANCO BILBAO VIZCAY SUB FF FRN/20-PERPET	7.000.000	6.602.960,00	2,03
EUR BANCO DE SABADELL FF FRN/23-PERPET	3.200.000	3.146.752,00	0,97
EUR BANCO DE SABADELL SA SUB FF FRN/21-PERP	2.600.000	1.978.860,00	0,61
EUR BANCO SANTANDER SA SUB FF FRN/20-PERPET	7.000.000	5.837.930,00	1,79
EUR BANK OF IRELAND GROUP SUB FF FRN/20-PERP	2.000.000	1.895.720,00	0,58
EUR BANK OF IRELAND GRP SUB FF FRN/20-PERPET	5.000.000	4.940.600,00	1,52
EUR BANKINTER SA SUB FF FRN/20-PERPET	5.000.000	4.754.150,00	1,46
GBP BARCLAYS PLC SUB FF FRN/19-PERPET	8.000.000	8.580.724,41	2,64
EUR BAWAG GROUP AG SUB FF FRN/20-PERPET	6.000.000	4.508.880,00	1,38
EUR BAYERISCHE LANDESBANK SUB FRN/23-050134	3.000.000	3.008.070,00	0,92
EUR BNP PARIBAS FF FRN/23-PERPET	7.000.000	6.789.580,00	2,09
EUR BNP PARIBAS SUB FF FRN/22-PERPET	5.000.000	4.734.450,00	1,45
EUR BPCE SA SUB FF FRN/21-130142	4.000.000	3.466.960,00	1,06
EUR CAIXABANK SA SUB FF FRN/20-PERPET	6.000.000	5.448.660,00	1,67
EUR CAIXABANK SA SUB FF FRN/23-PERPET	4.000.000	3.909.480,00	1,20
EUR COMMERZBANK AG SUB FF FRN/20-PERPET	8.000.000	7.403.200,00	2,27
EUR COMMERZBANK AG SUB FF FRN/20-PERPET	2.000.000	1.706.600,00	0,52
EUR COOPERATIVE RABOBANK UA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	5.000.000	4.630.350,00	1,42
EUR COOPERATIVE RABOBANK UA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	8.000.000	7.080.480,00	2,17
EUR CREDIT AGRICOLE SA SUB FF FRN/20-PERPET	5.000.000	4.286.900,00	1,32
GBP CREDIT AGRICOLE SA SUB FF FRN/21-PERPET	7.000.000	7.558.923,14	2,32
USD DANSKE BANK A/S SUB FF FRN/18-PERPET	4.000.000	3.625.468,31	1,11
EUR DEUTSCHE BANK AG SUB FF FRN/21-PERPET	6.000.000	4.274.040,00	1,31
EUR DEUTSCHE BANK AG SUB FF FRN/22-PERPET	4.000.000	3.317.200,00	1,02
EUR DEUTSCHE BANK AG SUB FF FRN/22-PERPET	1.600.000	1.602.256,00	0,49
GBP DIRECT LINE SUB FF 4,75%/17-PERPET	2.000.000	1.663.119,22	0,51
USD EFG INTERNATIONAL AG SUB FF FRN/21-PERP	1.750.000	1.256.274,83	0,39
EUR ERSTE GROUP BANK AG (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	3.000.000	2.680.860,00	0,82
EUR ERSTE GROUP BANK AG SUB FF FRN/20-PERPET	5.000.000	3.954.200,00	1,21
GBP HSBC HOLDINGS PLC SUB FF FRN/18-PERPET	3.000.000	3.051.110,73	0,94
EUR HSBC HOLDINGS REG S FF 4,75%/17-PERPET	9.000.000	7.438.050,00	2,28
USD ING GROEP NV SUB FF FRN/19-PERPET	9.000.000	7.488.221,38	2,30
USD ING GROUP FF 15-PERPET	1.000.000	888.382,21	0,27
EUR INTESA SANPAOLO SPA SUB FF FRN/20-PERPET	4.000.000	3.349.440,00	1,03
EUR JULIUS BAER GRP LTD SUB FF FRN/23-PERPET	7.000.000	5.958.680,00	1,83
EUR KBC GROUP NV SUB FF FRN/18-PERPET	4.000.000	3.430.000,00	1,05
EUR KBC GROUP NV SUB FF FRN/23-PERPET	3.000.000	2.979.900,00	0,92
EUR LB BADEN-WUERTTEMBERG SUB FF FRN/19-PERPET	7.000.000	4.971.890,00	1,53
GBP LEGAL & GENERAL GROUP SUB FF FRN/PERPET	4.000.000	3.607.600,02	1,11
GBP LLOYDS BANKING GRP SUB FF FRN/14-PERPET	8.000.000	8.123.988,29	2,49
EUR LLOYDS BANKING REG S FF 6,375%/14-PERPET	3.000.000	2.804.670,00	0,86
EUR MEDIOBANCA CRED FIN SUB FF FRN/20-231130	4.000.000	3.625.160,00	1,11
GBP NATIONWIDE BLDG SOC SUB FF FRN/19-PERPET	6.000.000	6.519.510,94	2,00
GBP NATIONWIDE BLDG SOC SUB FF FRN/20-PERPET	1.000.000	978.703,86	0,30
GBP NATWEST GROUP PLC SUB FF FRN/20-PERPET	7.000.000	6.665.931,92	2,05
USD NORDEUTSCH LB GIR REG S 6,25%/14-100424	4.000.000	3.718.940,40	1,14
USD NORDEA BANK ABP SUB FF FRN/19-PERPET	7.000.000	6.205.165,56	1,91
EUR NOVO BANCO LUX S 4 3,5%/13-230143	3.000.000	2.217.720,00	0,68
EUR NYKREDIT REALKREDIT AS FF FRN/20-PERPET	7.000.000	6.462.400,00	1,98
EUR PERMANENT TSB GROUP FF FRN/23-300629	2.000.000	2.028.080,00	0,62
EUR RAIFFEISEN BANK INTL SUB FF FRN/20-PERPE	7.000.000	5.764.990,00	1,77
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND FF 15-PERPET	2.000.000	1.834.001,89	0,56
USD SKANDINAVISKA ENSKI SUB FF FRN/22-PERPET	1.200.000	1.065.763,48	0,33
USD SOCIETE GENERALE SUB FF FRN/20-PERPET	5.000.000	3.396.121,10	1,04
EUR SOCIETE GENERALE SUB FF FRN/23-PERPET	6.100.000	5.759.315,00	1,77
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	9.000.000	6.396.215,70	1,96
CHF UBS GROUP AG SUB FF FRN/19-PERPET	6.000.000	5.414.002,81	1,66
USD UBS GROUP AG SUB FF FRN/20-PERPET	3.400.000	2.872.726,58	0,88
EUR UNICREDIT FF 5,375%/17-PERPET	7.000.000	6.367.760,00	1,96
EUR UNIONE DI BANCHI ITALIA SUB FF FRN/PERPET	6.000.000	5.701.920,00	1,75
EUR UNIPOLSAI ASSICURAZIONI S FF FRN/PERPET	4.000.000	3.440.440,00	1,06
EUR VAN LANSCHOT NV SUB FF FRN/19-PERPET	1.000.000	937.490,00	0,29
EUR VOLKSBANK WIEN AG SUB/18-PERPET	4.000.000	3.766.680,00	1,16
USD ZURICH FINANCE IRELAND (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/21-19.04.2051	3.000.000	2.117.455,06	0,65
Total Anleihen		305.559.106,84	93,84
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
		305.559.106,84	93,84
Total des Wertpapierbestandes			
		305.559.106,84	93,84
Bareinlagen bei Banken und Brokern		15.592.864,96	4,79

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-552.158,04	-0,17
Andere Nettovermögenswerte		5.029.201,70	1,54
Teilfondsvermögen		325.629.015,46	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
DA - Ausschüttend	USD	49408634	LU2039695387	0,00%
DB - Thesaurierend	USD	26580401	LU1166641354	0,00%
IA - Ausschüttend	USD	26580275	LU1166640620	0,75%
IB - Thesaurierend	USD	26607283	LU1166642592	0,75%
QA - Ausschüttend	USD	26607271	LU1166641941	1,00%
QAH - Ausschüttend	CHF	26607277	LU1166642162	1,00%
DBH - Thesaurierend	EUR	50890536	LU2076257877	0,00%
QAH - Ausschüttend	EUR	26607278	LU1166642246	1,00%

Für die Aktienklassen -DA-, -DB- und -DBH- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund wurde am 21.07.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		PTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
DA - Ausschüttend	USD	/	/	-17,82%	7,09%	4,70%
DB - Thesaurierend	USD	-1,82%	/	-17,82%	7,09%	4,72%
IA - Ausschüttend	USD	-2,41%	/	-18,57%	5,16%	2,92%
IB - Thesaurierend	USD	-2,41%	/	-18,58%	5,10%	3,13%
QA - Ausschüttend	USD	-2,54%	/	-18,77%	4,97%	2,54%
QAH - Ausschüttend	CHF	-4,63%	/	-20,96%	4,08%	0,65%
DBH - Thesaurierend	EUR	/	/	-19,64%	6,19%	2,56%
QAH - Ausschüttend	EUR	-3,78%	/	-20,66%	4,46%	0,71%

PTD = Performance To Date (01.01.2023 – 21.07.2023)

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
DA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	15,00
DA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	15,00
IA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	15,00
IA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	15,00
IA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	15,00
QA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	15,00
QA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	15,00
QA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	15,00
QAH - Ausschüttend	CHF	06.12.2022	15,00
QAH - Ausschüttend	CHF	07.03.2023	15,00
QAH - Ausschüttend	CHF	06.06.2023	15,00
QAH - Ausschüttend	EUR	06.12.2022	15,00
QAH - Ausschüttend	EUR	07.03.2023	15,00
QAH - Ausschüttend	EUR	06.06.2023	15,00

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

	21.07.2023
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	106.995,94
Bareinlagen bei Banken und Brokern	204.160,79
	311.156,73
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	303.785,16
Rückstellungen für Aufwendungen	7.371,57
	311.156,73
Nettovermögen	0,00

Teilfondsentwicklung		21.07.2023	31.10.2022	31.10.2021
Teilfondsvermögen	USD	303.782,16*	79.927.240,26	228.599.347,81
Nettoinventarwert pro Aktie				
DA - Ausschüttend	USD	/	776,02	1.033,91
DB - Thesaurierend	USD	16,67	1.171,28	1.459,34
IA - Ausschüttend	USD	9,53	724,17	977,89
IB - Thesaurierend	USD	12,50	892,70	1.122,49
QA - Ausschüttend	USD	7,95	612,84	839,93
QAH - Ausschüttend	CHF	6,14	493,83	703,99
DBH - Thesaurierend	EUR	/	879,33	1.116,32
QAH - Ausschüttend	EUR	6,54	516,32	732,26

*TNA vor Liquidation

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
DA - Ausschüttend	USD	0,000	10.949,627	0,000	10.949,627
DB - Thesaurierend	USD	0,000	25.278,497	138,882	25.417,379
IA - Ausschüttend	USD	0,000	10.740,591	150,000	10.890,591
IB - Thesaurierend	USD	0,000	6.238,623	76,752	6.315,375
QA - Ausschüttend	USD	0,000	17.979,862	0,000	17.979,862
QAH - Ausschüttend	CHF	0,000	9.872,146	250,000	10.122,146
DBH - Thesaurierend	EUR	0,000	12.679,196	0,000	12.679,196
QAH - Ausschüttend	EUR	0,000	3.067,068	0,000	3.067,068

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

	Für die Periode vom 01.11.2022 bis zum 21.07.2023 (Liquidationsdatum)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	79.927.240,26
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.420.293,30
Bankzinsen	62.669,21
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	57.073,34
	2.540.035,85
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	176.347,89
Depotbank- und Depotgebühr	23.129,66
Zentralverwaltungsvergütung	12.719,75
Druck- und Veröffentlichungskosten	9.178,55
Zinsen und Bankspesen	1.321,39
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	51.341,05
"Taxe d'abonnement"	7.837,34
	281.875,63
Nettoerträge (-verluste)	2.258.160,22
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-39.061.906,78
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	411.984,93
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-119.452,72
	-38.769.374,57
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-36.511.214,35
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	40.196.128,23
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-2.531.231,59
	37.664.896,64
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	1.153.682,29
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	482.260,18
Rücknahmen	-79.681.701,51
	-79.199.441,33
Ausschüttung	-1.881.481,22
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	0,00

Aufstellung des Wertpapierbestandes**Geographische Aufteilung**

Irland	23,05
Luxemburg	7,64
Spanien	4,54
Total	35,22

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	27,58
Baustoffe und Bauindustrie	7,64
Total	35,22

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD ALFA BANK (ALFA BOND) (SUBORDINATED) 5,95%/19-15.04.2030	1.000.000	13.780,00	4,54
EUR CODERE NEW HOLDCO 7.5%/21-301127	2.182.616	69.210,75	22,78
Total Anleihen		82.990,75	27,32
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		82.990,75	27,32
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Aktien			
EUR ABENGOA	16.972	0,06	0,06
EUR ABENGOA B	2.178.239	7,58	7,58
EUR TOPCO A	75.857	0,26	0,26
Total Aktien		24.005,19	7,90
Nicht börsennotierte Wertpapiere		24.005,19	7,90
Total des Wertpapierbestandes		106.995,94	35,22
Bareinlagen bei Banken und Brokern		204.160,79	67,21
Andere Passiva		-7.371,41	-2,43
Teilfondsvermögen		303.785,32	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
A - Ausschüttend	EUR	40678902	LU1785831402	0,65%	0,92%
B - Thesaurierend	EUR	25772629	LU1126274130	0,65%	0,92%
EA - Ausschüttend	EUR	40678903	LU1785831584	0,20%	0,44%
EB - Thesaurierend	EUR	10348197	LU0439683276	0,20%	0,43%
IB - Thesaurierend	EUR	25772649	LU1126274569	0,30%	0,57%
UB - Thesaurierend	EUR	40678962	LU1785831667	0,45%	0,72%
EBH - Thesaurierend	CHF	10348198	LU0439683516	0,20%	0,51%
DBH - Thesaurierend	USD	23143274	LU1007182436	0,00%	/
EBH - Thesaurierend	USD	10348189	LU0439682898	0,20%	0,52%

Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund -DBH- USD wurde am 05.05.2023 lanciert.

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die -DBH- Aktien.

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

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	EUR	2,09%	/	-12,91%	-0,90%	3,24%
B - Thesaurierend	EUR	2,08%	/	-12,90%	-0,90%	3,25%
EA - Ausschüttend	EUR	2,50%	/	-12,48%	-0,41%	3,75%
EB - Thesaurierend	EUR	2,51%	/	-12,48%	-0,42%	3,75%
IB - Thesaurierend	EUR	2,38%	/	-12,60%	-0,56%	3,58%
UB - Thesaurierend	EUR	2,26%	/	-12,73%	-0,71%	3,46%
EBH - Thesaurierend	CHF	0,82%	/	-13,01%	-0,70%	3,42%
DBH - Thesaurierend	USD	/	1,21%	/	/	/
EBH - Thesaurierend	USD	4,35%	/	-10,70%	0,30%	5,32%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	EUR	20.12.2022	0,81
EA - Ausschüttend	EUR	20.12.2022	1,30

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In EUR)
EUR	1.473.864	USD	-1.600.000	08.11.2023	-39.373,22
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	9.100	EUR	-9.657	09.11.2023	-191,71
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	21.787.800	EUR	-20.630.921	09.11.2023	-25.618,22
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	4.534.100	EUR	-4.719.762	09.11.2023	-3.624,01
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	21.292.500	EUR	-20.086.753	24.11.2023	37.665,87
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	4.543.200	EUR	-4.825.983	24.11.2023	-95.838,54
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					

Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften

-126.979,83

Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		231.405.003,77			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.659.346,89			
Forderungen aus Erträgen		2.074.384,95			
		235.138.735,61			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		81.086,64			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		126.979,83			
		208.066,47			
Nettovermögen		234.930.669,14			
Teilfondsentwicklung					
		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	EUR	234.930.669,14	210.882.932,01	250.746.317,65	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	EUR	90,98	89,10	104,09	
B - Thesaurierend	EUR	94,12	91,35	105,84	
EA - Ausschüttend	EUR	91,40	89,55	104,63	
EB - Thesaurierend	EUR	133,81	129,24	149,01	
IB - Thesaurierend	EUR	1.013,59	980,32	1.131,89	
UB - Thesaurierend	EUR	95,15	92,16	106,57	
EBH - Thesaurierend	CHF	122,61	120,72	139,72	
DBH - Thesaurierend	USD	1.012,12	/	/	
EBH - Thesaurierend	USD	156,63	147,79	167,65	
Anzahl der Aktien im Umlauf					
		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	EUR	40.165.661	46.293.225	357.772	6.485.336
B - Thesaurierend	EUR	80.034.107	85.035.401	8.067.641	13.068.935
EA - Ausschüttend	EUR	35.360.849	40.495.353	12.177.010	17.311.514
EB - Thesaurierend	EUR	1.265.677.204	1.321.729.277	92.330.440	148.382.513
IB - Thesaurierend	EUR	457.283	457.283	0,000	0,000
UB - Thesaurierend	EUR	647.737	647.737	0,000	0,000
EBH - Thesaurierend	CHF	74.570.000	132.410.000	2.500.000	60.340.000
DBH - Thesaurierend	USD	35.856.101	0,000	39.990.285	4.134.184
EBH - Thesaurierend	USD	45.834.879	52.705.000	10.679.879	17.550.000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in EUR)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	210.882.932,01
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	4.034.250,73
Bankzinsen	50.076,12
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	105.830,68
	4.190.157,53
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	708.023,22
Depotbank- und Depotgebühr	128.600,46
Zentralverwaltungsvergütung	41.820,21
Druck- und Veröffentlichungskosten	15.869,93
Zinsen und Bankspesen	585,15
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	101.210,23
"Taxe d'abonnement"	25.582,15
	1.021.691,35
Nettoerträge (-verluste)	3.168.466,18
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-6.448.421,04
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	308.965,03
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	1.385.334,57
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-41.921,32
	-4.796.042,76
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.627.576,58
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	9.782.319,66
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	627.186,73
	10.409.506,39
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	8.781.929,81
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	52.272.589,64
Rücknahmen	-36.916.981,70
	15.355.607,94
Ausschüttung	-89.800,62
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	234.930.669,14

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	20,90
Niederlande	12,44
Frankreich	11,32
Grossbritannien	9,92
Deutschland	8,74
Luxemburg	6,36
Spanien	5,73
Italien	4,70
Japan	2,93
Schweiz	2,69
Schweden	2,63
Dänemark	2,35
Irland	1,96
Kanada	1,84
Belgien	1,59
Österreich	0,95
Finnland	0,42
Australien	0,38
Vereinigte Arabische Emirate	0,38
Saudi-Arabien	0,25
Total	98,50

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	41,41
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	22,60
Tabak und alkoholische Getränke	4,86
Telekommunikation	4,14
Energie- und Wasserversorgung	3,86
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	3,53
Länder und Zentralregierungen	2,97
Petroleum	2,11
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,86
Versicherungsgesellschaften	1,58
Fahrzeuge	1,38
Elektrische Geräte und Komponenten	1,34
Chemie	1,25
Computerhardware und Netzwerk	0,98
Grafikverlags- und Druckmedien	0,60
Luft- und Raumfahrtindustrie	0,60
Verpackungsindustrie	0,42
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,42
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	0,42
Immobilien	0,41
Diverse Dienstleistungen	0,38
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,37
Verkehr und Transport	0,35
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,35
Gesundheits- und Sozialdienste	0,32
Total	98,50

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
EUR ABBV INC 0.75%/19-181127	1.000.000	885.850,00	0,38
EUR ABN AMRO BANK N.V. 0.5%/21-230929	2.500.000	1.994.175,00	0,85
EUR ACEA SPA 0.25%/21-280730	1.000.000	767.600,00	0,33
EUR AIB GROUP PLC FF FRN/22-040726	1.100.000	1.083.984,00	0,46
EUR AIB GROUP PLC FF FRN/23-230729	1.000.000	983.460,00	0,42
EUR ALLIANZ FINANCE II B.V. 0.5%/21-221133	1.500.000	1.081.755,00	0,46
EUR AMERICAN INTL GROUP 1.875%/17-21.06.2027	1.000.000	920.710,00	0,39
EUR ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.625%/19-110326	1.000.000	945.240,00	0,40
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA 2.875%/20-020432	1.250.000	1.159.050,00	0,49
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/1.125%/19-010727	1.000.000	915.310,00	0,39
EUR ASAHII GROUP HOLDINGS 0.336%/21-190427	1.500.000	1.326.045,00	0,56
EUR ASSICURAZIONI GE SUB 1.713%/21-300632	1.000.000	728.260,00	0,31
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 4.125%/14-04.05.2026	1.000.000	992.500,00	0,42
EUR ASTRAZENCA PLC 0.375%/21-030629	1.500.000	1.250.520,00	0,53
EUR AT&T INC 0.8%/19-04.03.2030	1.200.000	977.016,00	0,42
EUR AT&T INC 1.8%/18-05.09.2026	1.500.000	1.416.270,00	0,60
EUR AT&T INC 4.3%/23-181134	1.050.000	1.020.274,50	0,43
EUR BALL CORP 0.875%/19-150324	1.000.000	988.390,00	0,42
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARG (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-16.01.2030	1.500.000	1.414.575,00	0,60
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 0.5%/20-140127	1.000.000	888.270,00	0,38
EUR BANCO DE SABADELL SA 1.125%/19-27.03.2025	700.000	666.575,00	0,28
EUR BANCO DE SABADELL SA FF FRN/20-110327	1.000.000	924.680,00	0,39
EUR BANCO DE SABADELL SA FF FRN/23-070629	800.000	805.168,00	0,34
EUR BANCO SANTANDER SA 3.875%/23-160128	1.500.000	1.485.150,00	0,63
EUR BANK OF AMERICA CORP FF FRN/18-250428	1.000.000	913.960,00	0,39
EUR BANK OF AMERICA CORP FF FRN/22-270433	2.500.000	2.185.750,00	0,93
EUR BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-08.08.2029	1.500.000	1.257.450,00	0,54
EUR BANKIA SA SUB FF FRN/19-150229	1.500.000	1.491.150,00	0,63
EUR BANKINTER SA 0.625%/20-06.10.2027	1.000.000	870.210,00	0,37
EUR BANQUE FED CRED MUTUEL 1.25%/20-03.06.2030	1.500.000	1.215.690,00	0,52
EUR BARCLAYS FF 1.375%/18-240126	1.500.000	1.440.075,00	0,61
EUR BAXTER INTERNATIONAL INC 1.3%/19-150529	1.000.000	853.770,00	0,36
EUR BAYER AG 0.75%/20-060127	1.700.000	1.538.381,00	0,65
EUR BAYER AG FRN/23-250983	1.400.000	1.390.886,00	0,59
EUR BAYER CAPITAL CORP BV 1.5%/18-26.06.2026	1.500.000	1.406.685,00	0,60
EUR BECTON DICKINSON EURO 0.334%/21-130828	900.000	759.753,00	0,32
EUR BECTON DICKINSON REG S 1.9%/16-151226	900.000	847.035,00	0,36
EUR BERRY GLOBAL INC 1%/20-15.01.2025	750.000	720.217,50	0,31
EUR BEVCO LUX SARL 1.5%/20-16.09.2027	2.000.000	1.809.600,00	0,77
EUR BNP PARIBAS 2.1%/22-070432	2.500.000	2.063.050,00	0,88
EUR BNP PARIBAS FF FRN/21-300528	1.400.000	1.221.276,00	0,52
EUR BNP PARIBAS SUB FF FRN/18-201130	1.500.000	1.419.585,00	0,60
EUR BOSTON SCIENTIFIC CORP 0.625%/19-011227	2.000.000	1.761.240,00	0,75
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	2.000.000	1.881.300,00	0,80
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC 1.231%/19-08.05.2031	1.000.000	812.040,00	0,35
EUR BPCE SA 2.375%/22-260432	1.000.000	860.710,00	0,37
EUR BRITISH TELECOMMUNICATIO 1.125%/19-12.09.2029	500.000	422.530,00	0,18
EUR BRITISH TELECOMMUNICATIO 1.5%/17-230627	1.000.000	916.680,00	0,39
EUR BRITISH TELECOMMUNICATIO 3.75%/23-130531	450.000	431.113,50	0,18
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0%/22-150232	2.800.000	2.244.060,00	0,96
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.3%/23-150233	4.000.000	3.849.440,00	1,64
EUR CAIXABANK SA 1.375%/19-190626	1.000.000	927.170,00	0,39
EUR CAIXABANK SA FF FRN/21-090229	900.000	756.756,00	0,32
EUR CARLSBERG BREWERIES A/S 0.625%/20-090330	2.500.000	2.032.825,00	0,87
EUR CARLSBERG BREWERIES A/S 4%/23-051028	1.050.000	1.053.391,50	0,45
EUR CEP SA FINANCE SA 2.25%/20-13.02.2026	1.500.000	1.433.310,00	0,61
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 1.4%/19-15.06.2031	1.500.000	1.222.860,00	0,52
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 1.55%/18-150328	1.000.000	901.890,00	0,38
EUR CITIGROUP INC 1.25%/19-10.04.2029	2.500.000	2.133.350,00	0,91
EUR CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/19-08.10.2027	2.000.000	1.794.680,00	0,76
EUR CK HUTCHISON GP TELECOM 1.125%/171028	1.000.000	865.990,00	0,37
EUR CK HUTCHISON GROUP 1.5%/19-171031	1.000.000	782.770,00	0,33
EUR CNH INDUSTRIAL FIN EUR S 1.75%/17-12.09.2025	1.000.000	962.530,00	0,41
EUR CNH INDUSTRIAL FIN EUR S 1.75%/19-250327	2.000.000	1.859.700,00	0,79
EUR COCA-COLA EUROPEAN PARTN 1.75%/20-27.03.2026	1.500.000	1.432.035,00	0,61
EUR COMMERZBANK AG 0.25%/19-160924	2.000.000	1.935.440,00	0,82
EUR COOPERATIEVE RABOBAN UA FF FRN/23-260429	2.000.000	1.985.400,00	0,85
EUR CREDIT AGRICOLE SA 0.375%/21-200428	3.000.000	2.538.570,00	1,08
EUR CREDIT AGRICOLE SA 1.125%/22-240229	1.000.000	867.650,00	0,37
EUR CREDIT AGRICOLE SA 3.375%/22-280727	300.000	292.764,00	0,12
EUR CREDIT AGRICOLE SUB 3%/14-221224	1.000.000	986.490,00	0,42
EUR DAIMLER AG 1.5%/17-03.07.2029	1.000.000	879.570,00	0,37
EUR DANSKE BANK A/S (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-21.06.2029	1.000.000	981.760,00	0,42
EUR DANSKE BANK A/S FF FRN/22-170227	1.550.000	1.443.003,50	0,61
EUR DEUTSCHE BANK AG 1.625%/20-200127	1.500.000	1.354.620,00	0,58
EUR DEUTSCHE BANK AG 1.75%/18-170128	1.000.000	879.560,00	0,37
EUR DEUTSCHE BANK AG FF FRN/20-191130	1.100.000	886.490,00	0,38

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	10671030	LU0458987335	1,20%	1,42%
DB - Thesaurierend	USD	3679056	LU0340004091	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	USD	56484303	LU2215766085	0,52%	0,70%
EB - Thesaurierend	USD	3679053	LU0340003523	0,52%	0,70%
MB - Thesaurierend	USD	27057495	LU1189105080	0,30%	0,48%
BH - Thesaurierend	CHF	10671043	LU0458987418	1,20%	1,42%
DBH - Thesaurierend	CHF	23143246	LU1007181461	0,00%	0,12%
EBH - Thesaurierend	CHF	3679067	LU0340004760	0,52%	0,70%
EBH - Thesaurierend	EUR	3679066	LU0340004505	0,52%	0,70%

Für die Aktienklassen -DB- und -DBH- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	USD	5,05%	/	-11,58%	3,84%	4,04%
DB - Thesaurierend	USD	6,19%	/	-10,43%	5,19%	5,34%
EA - Ausschüttend	USD	5,67%	3,64%	-10,94%	4,60%	/
EB - Thesaurierend	USD	5,67%	/	-10,94%	4,60%	4,71%
MB - Thesaurierend	USD	5,86%	/	-10,75%	4,83%	4,95%
BH - Thesaurierend	CHF	1,48%	/	-13,91%	2,74%	1,78%
DBH - Thesaurierend	CHF	2,65%	/	-12,90%	4,09%	3,05%
EBH - Thesaurierend	CHF	2,11%	/	-13,35%	3,53%	2,45%
EBH - Thesaurierend	EUR	3,67%	/	-13,00%	3,73%	2,83%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
EA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	11,97
EA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	12,36
EA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	11,92
EA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	12,60

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In USD)
EUR	2.000.000	USD	-2.139.113	13.12.2023	-21.037,20
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
EUR	1.000.000	USD	-1.084.342	13.12.2023	-25.304,20
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
EUR	1.500.000	USD	-1.638.866	13.12.2023	-50.308,50
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
USD	328.575	EUR	-300.000	13.12.2023	10.842,70
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
USD	1.359.030	EUR	-1.240.000	13.12.2023	45.734,78
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	326.214	EUR	-300.000	13.12.2023	8.486,54
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	989.796	EUR	-900.000	13.12.2023	36.590,95
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	321.202	EUR	-300.000	13.12.2023	3.483,45
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	754.680	EUR	-700.000	13.12.2023	13.327,50
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	2.009.746	EUR	-1.829.304	13.12.2023	72.303,61
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
USD	2.175.905	EUR	-1.990.873	13.12.2023	67.364,89
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
EUR	1.800.000	USD	-1.953.699	13.12.2023	-47.430,72
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
USD	87.253.317	EUR	-80.848.124	13.12.2023	1.628.940,32
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
GBP	182.014	USD	-222.307	13.12.2023	-1.371,53
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
EUR	1.200.000	USD	-1.337.960	13.12.2023	-67.114,08
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
USD	210.789	GBP	-163.724	13.12.2023	12.049,75
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	278.570	EUR	-250.000	13.12.2023	13.783,84
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	1.673.133	EUR	-1.500.000	13.12.2023	84.412,79
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
EUR	750.000	USD	-828.328	13.12.2023	-34.049,25
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	7.128.076	EUR	-6.500.000	13.12.2023	243.858,31
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	2.160.225	USD	-2.345.375	13.12.2023	-57.614,28
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
GBP	202.956	USD	-247.530	13.12.2023	-1.173,29
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	2.468.667	EUR	-2.300.000	13.12.2023	32.816,15
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	3.138.934	EUR	-2.900.000	13.12.2023	67.593,37
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	379.876	EUR	-350.000	13.12.2023	9.195,26
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
EUR	500.000	USD	-545.692	13.12.2023	-16.172,50
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.268.023	EUR	-1.150.000	13.12.2023	50.032,39
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
EUR	3.000.000	USD	-3.259.124	13.12.2023	-82.009,80
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
EUR	400.000	USD	-432.724	13.12.2023	-9.108,32
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	548.749	EUR	-500.000	13.12.2023	19.192,89
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	2.195.142	EUR	-2.000.000	13.12.2023	76.917,70
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	479.258	EUR	-450.000	13.12.2023	2.685,37
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	246.047	GBP	-206.345	13.12.2023	-4.422,53
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	2.744.674	EUR	-2.550.000	13.12.2023	44.042,33
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	6.718.101	EUR	-6.250.000	13.12.2023	98.922,40
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	221.263	GBP	-177.721	13.12.2023	5.535,78
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
EUR	2.000.000	USD	-2.162.936	13.12.2023	-44.860,00
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	9.663.315	GBP	-7.823.038	13.12.2023	167.333,09
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
EUR	750.000	USD	-793.193	13.12.2023	1.085,62
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
EUR	3.500.000	USD	-3.719.989	13.12.2023	-13.356,00
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
EUR	5.000.000	USD	-5.637.070	13.12.2023	-341.880,50
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	2.614.474	EUR	-2.400.773	13.12.2023	71.826,35
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.086.424	EUR	-1.000.000	13.12.2023	27.333,30
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	1.081.801	EUR	-1.000.000	13.12.2023	22.718,89
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.054.602	EUR	-947.652	13.12.2023	50.904,46
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	1.447.569	CHF	-1.318.590	18.12.2023	-9.002,93
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	1.012.032	EUR	-960.500	18.12.2023	-5.469,36
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
USD	363.481	CHF	-331.094	18.12.2023	-2.260,61
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	7.316	CHF	-6.664	18.12.2023	-45,50
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	449.705	EUR	-420.441	18.12.2023	4.296,99
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
CHF	563.986	USD	-636.356	18.12.2023	-13.331,49
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
EUR	67.429.675	USD	-72.200.324	18.12.2023	-768.091,43
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	3.991.012	USD	-4.419.871	18.12.2023	-11.079,60
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	784.067	CHF	-704.303	18.12.2023	6.006,26
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
CHF	2.082.552	USD	-2.318.409	18.12.2023	-17.854,77
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	6.190	CHF	-5.494	18.12.2023	120,72
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	949.514	CHF	-868.011	18.12.2023	-9.310,70
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	7.754	CHF	-7.066	18.12.2023	-51,87
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	734.824	EUR	-696.743	18.12.2023	-3.270,10
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	1.373.364	CHF	-1.251.585	18.12.2023	-9.187,91
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
CHF	115.837.127	USD	-130.701.111	18.12.2023	-2.738.153,39
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
CHF	66.182.775	USD	-74.675.213	18.12.2023	-1.564.425,78
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	926.636	CHF	-822.052	18.12.2023	18.432,95
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	930.710	EUR	-878.186	18.12.2023	395,35
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	819.861	CHF	-733.812	18.12.2023	9.183,95
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	894.333	CHF	-803.342	18.12.2023	6.860,76
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	824.998	CHF	-741.061	18.12.2023	6.328,86
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	766.288	EUR	-712.171	18.12.2023	11.816,39
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	10.204.119	EUR	-9.317.358	12.02.2024	304.130,60
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-2.611.860,53

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		573.254.242,01			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		15.802.449,38			
Forderungen aus Zeichnungen		4.411.832,07			
Forderungen aus Erträgen		10.170.608,47			
Andere Aktiva		12.968,82			
		603.652.100,75			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		1.090.000,00			
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		981.802,81			
Rückstellungen für Aufwendungen		232.274,84			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		2.611.860,53			
		4.915.938,18			
Nettovermögen		598.736.162,57			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	598.736.162,57	598.985.831,50	994.821.641,53	
Nettoinventarwert pro Aktie					
B - Thesaurierend	USD	129,78	120,44	138,64	
DB - Thesaurierend	USD	1.370,55	1.255,61	1.426,79	
EA - Ausschüttend	USD	897,64	872,81	1.045,91	
EB - Thesaurierend	USD	238,09	219,40	250,74	
MB - Thesaurierend	USD	1.322,81	1.216,26	1.386,94	
BH - Thesaurierend	CHF	106,11	102,83	120,82	
DBH - Thesaurierend	CHF	1.193,86	1.141,33	1.325,28	
EBH - Thesaurierend	CHF	181,72	174,76	204,05	
EBH - Thesaurierend	EUR	199,09	188,22	219,18	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	USD	18.759,957	13.814,119	76.599,656	71.653,818
DB - Thesaurierend	USD	26.166,186	57.772,020	8.526,557	40.132,391
EA - Ausschüttend	USD	28.443,797	31.467,533	7.345,663	10.369,399
EB - Thesaurierend	USD	388.924,198	560.274,040	61.798,997	233.148,839
MB - Thesaurierend	USD	133.427,639	117.891,621	42.276,246	26.740,228
BH - Thesaurierend	CHF	5.162,088	6.518,002	542,000	1.897,914
DBH - Thesaurierend	CHF	99.619,912	73.132,544	31.555,103	5.067,735
EBH - Thesaurierend	CHF	337.117,220	448.789,725	23.012,974	134.685,479
EBH - Thesaurierend	EUR	319.373,243	368.569,103	63.581,532	112.777,392

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	598.985.831,50
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	38.391.400,80
Dividenden (Netto)	7.889,45
Bankzinsen	788.866,94
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	408.184,01
	39.596.341,20
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	2.072.732,70
Depotbank- und Depotgebühr	370.876,64
Zentralverwaltungsvergütung	433.725,18
Druck- und Veröffentlichungskosten	22.826,57
Zinsen und Bankspesen	135.907,40
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	190.649,41
"Taxe d'abonnement"	48.265,49
	3.274.983,39
Nettoerträge (-verluste)	36.321.357,81
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-32.512.969,64
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	20.088.062,63
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	3.599.153,18
	-8.825.753,83
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	27.495.603,98
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	53.963.135,30
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-15.463.023,84
	38.500.111,46
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	65.995.715,44
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	155.807.834,70
Rücknahmen	-220.537.642,59
	-64.729.807,89
Ausschüttung	-1.515.576,48
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	598.736.162,57

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	67,19
Kanada	4,78
Grossbritannien	4,40
Niederlande	3,96
Luxemburg	3,51
Frankreich	3,32
Italien	2,36
Deutschland	1,52
Kaimaninseln	1,32
Irland	1,05
Schweden	0,64
Jersey	0,54
Spanien	0,38
Polen	0,29
Portugal	0,21
Österreich	0,09
Malta	0,08
Finnland	0,04
Rumänien	0,04
Total	95,74

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	33,69
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	6,78
Diverse Dienstleistungen	5,22
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	4,34
Petroleum	4,28
Maschinenbau und Industrieanlagen	4,16
Baustoffe und Bauindustrie	3,52
Telekommunikation	2,50
Nichteisenmetalle	2,42
Energie- und Wasserversorgung	2,35
Elektronik und Halbleiter	2,16
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	2,06
Verkehr und Transport	2,04
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	1,93
Chemie	1,73
Elektrische Geräte und Komponenten	1,72
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	1,47
Immobilien	1,45
Verschiedene Konsumgüter	1,45
Gesundheits- und Sozialdienste	1,42
Banken und andere Kreditinstitute	1,39
Fahrzeuge	1,39
Verpackungsindustrie	1,20
Einzelhandel und Warenhäuser	1,00
Computerhardware und Netzwerk	0,96
Umweltdienstleistungen und Recycling	0,75
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,73
Versicherungsgesellschaften	0,49
Verschiedene Investitionsgüter	0,47
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	0,38
Grafikverlags- und Druckmedien	0,21
Biotechnologie	0,11
Total	95,74

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
EUR SOLOCAL GROUP	203.669	16.404,20	0,00
EUR TECHNICOLOR SA	764.205	104.040,09	0,02
Total Aktien		120.444,29	0,02
Anleihen			
USD 1011778 BC / NEW RED 144A 3.5%/150229	1.000.000	858.330,00	0,14
USD ABC SUPPLY CO INC 144A 4%/19-150128	4.425.000	3.982.544,25	0,67
USD ACRESURE LLC / FIN INC -144A- 10.125%/19-01.08.2026	250.000	252.040,00	0,04
USD ACUSHNET CO 144A 7.375%/23-151028	350.000	351.127,00	0,06
USD ADAMS HOMES INC 144A 7.5%/20-150225	575.000	563.597,75	0,09
USD ADIENT GLOBAL HOLDINGS 144A 7%/23-150428	2.265.000	2.242.599,15	0,37
USD ADVANCED DRAINAGE 6.375%/22-150630	2.546.000	2.419.463,80	0,40
EUR AEDAS HOMES OPCO SLU 4%/21-150826	250.000	246.299,50	0,04
USD ALCOA NEDERLAND 144A 4.125%/21-310329	1.440.000	1.256.400,00	0,21
USD ALCOA NEDERLAND 144A 5.5%/20-151227	1.097.000	1.041.415,01	0,17
USD ALLIANT HOLD / CO-ISSUER 6.75%/23-150428	1.250.000	1.190.387,50	0,20
EUR ALLIED UNI HLD/ALL FIN 3.625%/21-010628	3.157.000	2.699.291,42	0,45
USD ALLIED UNIVERSAL 144A 6%/21-010629	4.250.000	3.077.042,50	0,51
USD ALLIED UNIVERSAL 144A 9.75%/19-150727	2.377.000	2.074.669,37	0,35
EUR ALTICE FINANCING S.A. 3%/20-150128	500.000	431.795,07	0,07
USD ALTICE FINANCING SA 144A 5%/20-150128	4.910.000	4.008.082,10	0,67
EUR ALTICE FINANCING SA 4.25%/21-150829	1.100.000	921.195,58	0,15
EUR ALTICE FRANCE HOLDING S.A. 8%/20-150527	1.250.000	725.722,99	0,12
EUR ALTICE FRANCE HOLDING S.A. 8%/20-150527	2.650.000	1.538.532,73	0,26
USD ALTICE FRANCE SA 144A 5.125%/21-150729	4.285.000	2.944.394,90	0,49
EUR ALTICE FRANCE SA 4.25%/21-151029	1.300.000	973.110,14	0,16
USD AMN HEALTHCARE INC 144A 4.625%/19-011027	3.075.000	2.761.042,50	0,46
EUR APCOA PARKING HOLD G 4.625%/21-150127	1.500.000	1.420.481,16	0,24
USD ARCO SA INC 144A 4.375%/21-150429	4.349.000	3.808.027,89	0,64
EUR ARDAGH METAL PACKAGING 3%/21-010929	1.900.000	1.489.214,70	0,25
EUR ARDAGH PKG FIN/HLDG USA 2.125%/20-150826	500.000	450.049,82	0,08
USD ARMOR HOLDCO INC 144A 8.5%/21-151129	6.675.000	5.841.359,25	0,98
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 144A 5%/150232	500.000	407.690,00	0,07
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 4.5%/20-01.03.2028	1.813.000	1.613.279,92	0,27
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 4.75%/20-01.03.2030	2.561.000	2.178.360,99	0,36
USD ASGN INCORPORATED 144A 4.625%/19-150528	2.302.000	2.050.092,14	0,34
USD ATKORE INC 144A 4.25%/21-010631	6.500.000	5.380.765,00	0,90
USD AUSTIN BIDCO INC 144A 7.125%/20-151228	9.767.000	7.796.214,74	1,30
USD AUTOMATION TOOLING 144A 4.125%/20-151228	2.274.000	1.952.479,14	0,33
USD AVIENT CORP 144A 7.125%/22-010830	500.000	483.420,00	0,08
USD BALL CORP 6.875%/22-150328	750.000	749.512,50	0,13
EUR BCP MODULAR SERVICES 4.75%/21-301128	250.000	219.953,77	0,04
GBP BELLIS ACQUISITION CO PL 4.5%/21-160226	750.000	810.724,64	0,14
GBP BELLIS FINCO PLC 4%/21-160227	3.250.000	2.931.153,04	0,49
EUR BENTELER A 144A 9.375%/23-150528	500.000	534.894,85	0,09
EUR BLITZ F 6%/18-300726	1.250.000	1.128.498,60	0,19
EUR BOELS TOPHOLDING BV 6.25%/23-150229	1.000.000	1.050.161,21	0,18
USD BOMBARDIER INC 144A 7.5%/23-010229	850.000	787.924,50	0,13
USD BOOZ ALLEN HAMILTON 144A 3.875%/010928	1.750.000	1.563.905,00	0,26
USD BOYNE USA INC 144A 4.75%/21-150529	7.435.000	6.502.799,70	1,09
EUR BRUNELLO BIDCO SPA 3.5%/21-15.02.2028	3.300.000	2.988.743,60	0,50
USD BUILDERS FIRST 144A 4.25%/21-010232	750.000	597.442,50	0,10
USD BUILDERS FIRSTSOURCE 6.375%/22-150632	2.887.000	2.649.226,68	0,44
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC 144A 5%/010330	650.000	568.847,50	0,10
USD CAESARS ENTERTAIN INC 144A 7%/23-150230	1.000.000	964.850,00	0,16
USD CANPACK SA/US 144A 3.875%/21-151129	2.250.000	1.759.725,00	0,29
USD CARGO AIRCRAFT MGMT 144A 4.75%/010228	3.493.000	3.084.633,37	0,52
USD CCO HLDGS LLC/CAP CORP 144A 4.5%/150830	2.400.000	1.928.904,00	0,32
USD CDI ESCROW 144A 5.75%/22-010430	1.475.000	1.321.806,50	0,22
EUR CENTURION BIDCO SPA 11.125%/23-150528	400.000	417.350,11	0,07
USD CENTURION BIDCO SPA 5.875%/20-30.09.2026	3.850.000	3.607.282,56	0,60
USD CHART INDUSTRIES 7.5%/22-010130	1.250.000	1.229.312,50	0,21
USD CHENIERE ENERGY 3.25%/22-310132	2.000.000	1.551.100,00	0,26
USD CHENIERE ENERGY INC 4.625%/21-151028	900.000	822.780,00	0,14
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS 4%/21-010331	2.000.000	1.676.020,00	0,28
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS 4.5%/20-011029	755.000	676.200,65	0,11
EUR CHEPLAPHARM 7.5%/23-150530	2.000.000	2.111.843,72	0,35
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL 4.375%/20-15.01.2028	1.250.000	1.206.803,33	0,20
EUR CHROME HOLDCO SUB 144A 5%/21-310529	500.000	383.458,46	0,06
EUR CHROME HOLDCO SUB 5%/21-310529	950.000	728.571,07	0,12
EUR CIRS FINANCE INTER 4.5%/21-150327	1.000.000	963.719,75	0,16
EUR CIRS FINANCE INTER 4.75%/19-220525	1.800.000	1.875.392,82	0,31
USD CIVITAS RESOURCES 8.375%/23-010728	1.550.000	1.563.004,50	0,26
USD CIVITAS RESOURCES 8.75%/23-010731	1.550.000	1.566.290,50	0,26
USD CLEAN HARBORS INC 144A 6.375%/23-010231	675.000	642.924,00	0,11
USD CLEVELAND-CLIFFS INC -144A- 6.75%/20-15.03.2026	500.000	498.415,00	0,08
USD CNX MIDSTREAM PART LP 4.75%/21-150430	3.552.000	2.931.145,92	0,49
USD CNX RESOURCES CORP 144A 6%/20-150129	75.000	68.916,75	0,01
EUR CODERE FIN 2 LUX REG S 6.75%/16-301127	2.062.500	56.377,51	0,01
EUR CODERE NEW HOLDCO 7.5%/21-301127	744.994	23.623,76	0,00
USD COMPASS GROUP DIVERSIFIE 144A 5%/150132	4.150.000	3.269.411,50	0,55
USD COMPASS GROUP DIVERSIFIE 5.25%/21-150429	3.000.000	2.568.330,00	0,43
GBP CONSTELLATION AUTOMOT 4.875%/21-150727	1.000.000	945.165,87	0,16
USD CORELOGIC INC 144A 4.5%/21-010528	7.000.000	5.557.020,00	0,93
USD CSC HOLDINGS LLC 144A 4.125%/20-011230	1.000.000	670.780,00	0,11

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

Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD TRONOX INC 144A 4.625%/21-150329	2.740.000	2.153.914,00	0,36
USD TWILIO INC 3.625%/21-150329	1.500.000	1.251.840,00	0,21
USD TWILIO INC 3.875%/21-150331	4.725.000	3.781.984,50	0,63
EUR UNITED GROUP BV 3.625%/20-150228	2.000.000	1.751.639,26	0,29
EUR UNITED GROUP BV 4%/20-151127	2.000.000	1.825.206,46	0,30
EUR UNITED GROUP BV FRN/20-150226	1.325.000	1.368.596,03	0,23
USD UNITED RENTALS NO 6%/22-151229	2.750.000	2.646.022,50	0,44
USD UFC BROADBAND FIN 144A 4.875%/21-150731	4.750.000	3.777.200,00	0,63
USD US FOODS INC 144A 4.625%/21-010630	640.000	547.289,60	0,09
USD US FOODS INC 144A 6.875%/23-150928	664.000	848.767,68	0,14
USD US FOODS INC 7.25%/23-150132	886.000	871.079,76	0,15
EUR VERDE BIDCO SPA 4.625%/21-011026	200.000	190.536,93	0,03
EUR VERSURE HOLDING AB 3.25%/21-150227	1.000.000	959.523,46	0,16
EUR VERSURE MIDHOLDING AB 5.25%/21-15.02.2029	1.850.000	1.693.908,56	0,28
USD VIAVI SOLUTIONS INC 144A 3.75%/21-011029	2.300.000	1.831.145,00	0,31
EUR VILLA DUTCH BIDCO BV 9%/22-031129	1.100.000	1.138.899,53	0,19
EUR VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 3.75%/20-150730	600.000	515.572,89	0,08
USD VISTAJET MALTA/XO 144A 6.375%/22-010230	758.000	508.087,40	0,08
EUR VMED O2 UK FINANCING I 3.25%/23-310131	1.000.000	878.293,01	0,15
USD VT TOPCO INC 144A 8.5%/23-150830	2.000.000	1.952.860,00	0,33
USD WESCO DISTRIBUTION INC 7.125%/20-150625	800.000	801.600,00	0,13
USD WESCO DISTRIBUTION INC 7.25%/20-150628	1.750.000	1.741.652,50	0,29
USD WMG ACQUISITION CORP 144A 3.875%/150730	5.250.000	4.384.800,00	0,73
EUR WMG ACQUISITION CORP 2.25%/21-150831	750.000	617.266,86	0,10
EUR WP/AF TELECOM 5.5%/21-150130	2.500.000	2.218.510,88	0,37
USD WR GRACE HOLDING LLC 7.375%/23-010331	1.112.000	1.032.558,72	0,17
USD XPO ESCROW SUB 7.5%/22-151127	3.600.000	3.597.660,00	0,60
USD XPO INC 144A 6.25%/23-010628	2.775.000	2.668.301,25	0,45
USD XPO INC 144A 7.125%/23-010631	1.135.000	1.107.340,05	0,18
USD YUM! BRANDS INC 3.625%/20-150331	1.550.000	1.260.212,00	0,21
USD YUM! BRANDS INC 5.375%/22-010432	184.000	165.544,80	0,03
USD ZI TECH LLC/ZI FIN CORP 3.875%/21-010229	3.885.000	3.212.234,55	0,54
EUR ZIGGO BV 2.875%/19-150130	100.000	84.692,13	0,01
USD ZIPRECRUITER INC 144A 5%/22-150130	2.836.000	2.216.022,04	0,37
EUR ZONCOLAN BIDCO SPA 4.875%/21-211028	2.659.000	1.758.484,95	0,29
Total Anleihen		571.538.468,16	95,46
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		571.658.912,45	95,48
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Aktien			
EUR TOPCO A	24.956	263,78	0,00
Total Aktien		263,78	0,00
Anleihen			
EUR BANIJAY ENTERTAINMENT 7%/23-010529	800.000	839.410,21	0,14
USD EAGLE INTERMEDIATE 7.5%/22-010525	122.000	79.367,47	0,01
USD EAGLE INTERMEDIATE 0%/22-010525	210.000	115.101,42	0,02
USD EAGLE INTERMEDIATE 7.5%/22-010525	36.000	23.419,91	0,00
EUR LOTTOMATICA 7.13%/23-010628	500.000	537.764,61	0,09
Total Anleihen		1.595.063,62	0,27
Privates Beteiligungskapital			
USD EAGLE INV HOLDCO CL B	216	2,16	0,00
Total Privates Beteiligungskapital		2,16	0,00
Nicht börsennotierte Wertpapiere		1.595.329,56	0,27
Total des Wertpapierbestandes		573.254.242,01	95,74
Bareinlagen bei Banken und Brokern		15.802.449,38	2,64
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-1.090.000,00	-0,18
Andere Nettovermögenswerte		10.769.471,18	1,80
Teilfondsvermögen		598.736.162,57	100,00

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

Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	30070817	LU1307159316	0,90%	1,13%
B - Thesaurierend	USD	10671046	LU0458987681	0,90%	1,13%
EB - Thesaurierend	USD	3449617	LU0324196079	0,32%	0,51%
IB - Thesaurierend	USD	30070835	LU1307159662	0,45%	0,68%
MB - Thesaurierend	USD	33386686	LU1457602677	0,20%	/
UA - Ausschüttend	USD	30070839	LU1307159829	0,55%	0,78%
UB - Thesaurierend	USD	30070847	LU1307160322	0,55%	0,78%
EAH - Ausschüttend	AUD	114771252	LU2407926216	0,32%	0,59%
EBH - Thesaurierend	CHF	3449717	LU0324196582	0,32%	0,59%
AH - Ausschüttend	EUR	30070826	LU1307159407	0,90%	1,21%
BH - Thesaurierend	EUR	10671056	LU0458988069	0,90%	1,20%
EBH - Thesaurierend	EUR	3449624	LU0324196400	0,32%	0,59%
IBH - Thesaurierend	EUR	24942761	LU1089177171	0,45%	0,75%
UAH - Ausschüttend	EUR	30070843	LU1307160082	0,55%	0,85%
UBH - Thesaurierend	EUR	30070851	LU1307160595	0,55%	0,85%

Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund -MB- wurde am 23.03.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	0,28%	/	-5,93%	4,39%	5,10%
B - Thesaurierend	USD	0,28%	/	-5,93%	4,40%	5,10%
EB - Thesaurierend	USD	0,79%	/	-5,35%	5,04%	5,75%
IB - Thesaurierend	USD	0,66%	/	-5,50%	4,86%	5,58%
MB - Thesaurierend	USD	/	/	-5,23%	5,17%	5,88%
UA - Ausschüttend	USD	0,58%	/	-5,60%	4,76%	5,47%
UB - Thesaurierend	USD	0,57%	/	-5,60%	4,75%	5,48%
EAH - Ausschüttend	AUD	-0,47%	-6,35%	-6,24%	/	/
EBH - Thesaurierend	CHF	-2,67%	/	-7,74%	3,85%	3,75%
AH - Ausschüttend	EUR	-1,62%	/	-7,90%	3,46%	3,37%
BH - Thesaurierend	EUR	-1,63%	/	-7,90%	3,46%	3,36%
EBH - Thesaurierend	EUR	-1,11%	/	-7,34%	4,10%	4,01%
IBH - Thesaurierend	EUR	-1,25%	/	-7,48%	3,92%	3,84%
UAH - Ausschüttend	EUR	-1,34%	/	-7,57%	3,80%	3,74%
UBH - Thesaurierend	EUR	-1,33%	/	-7,59%	3,82%	3,74%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
UA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	0,27
EAH - Ausschüttend	AUD	20.12.2022	0,43
UAH - Ausschüttend	EUR	20.12.2022	0,16

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In USD)
JPY	420.000.000	USD	-2.810.039	08.11.2023	-33.296,46
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	1.800.000	USD	-1.910.999	08.11.2023	-7.777,80
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	924.949	GBP	-730.000	08.11.2023	39.070,08
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	29.075.509	GBP	-22.842.000	08.11.2023	1.355.974,36
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	3.506.253	AUD	-5.436.000	08.11.2023	63.543,70
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
EUR	1.730.000	USD	-1.829.424	08.11.2023	-217,63
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
GBP	1.318.000	USD	-1.601.296	08.11.2023	-1.862,33
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.316.399	EUR	-1.210.000	08.11.2023	36.999,05
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	19.627.744	JPY	-2.820.127.000	08.11.2023	981.834,50
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	73.433.520	EUR	-67.610.000	08.11.2023	1.945.789,19
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	3.200.000	USD	-3.376.160	08.11.2023	7.344,00
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
GBP	2.209.354	USD	-2.758.212	08.11.2023	-77.092,23
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	2.490.432	NZD	-4.186.000	08.11.2023	55.617,26
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.576.889	SEK	-17.218.000	08.11.2023	35.302,48
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	5.231.383	CHF	-4.755.400	09.11.2023	1.197,56
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	442	AUD	-700	09.11.2023	-0,86
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.081	AUD	-1.700	09.11.2023	3,97
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	13.219	CHF	-11.800	09.11.2023	240,88
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	96.245	CHF	-85.800	09.11.2023	1.876,54
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	32.400	USD	-34.452	09.11.2023	-192,81
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	713.000	USD	-801.669	09.11.2023	-17.481,92
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	828.747	CHF	-742.600	09.11.2023	11.993,37
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
AUD	4.900	USD	-3.110	09.11.2023	-6,79
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
AUD	18.741.900	USD	-11.947.978	09.11.2023	-78.112,87
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	54.771	EUR	-51.800	09.11.2023	-1,50
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
AUD	72.700	USD	-46.064	09.11.2023	-20,57
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.907	EUR	-1.800	09.11.2023	3,85
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.685	CHF	-2.400	09.11.2023	44,95
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	246.100	USD	-260.901	09.11.2023	-678,25
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
AUD	2.500	USD	-1.582	09.11.2023	1,34
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	221.191	EUR	-208.700	09.11.2023	513,84
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	4.133	CHF	-3.700	09.11.2023	63,05
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	948	AUD	-1.500	09.11.2023	-2,03
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	36.391.900	USD	-38.416.822	09.11.2023	63.536,62
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					<i>(In USD)</i>
CHF	28.145.800	USD	-30.943.069	09.11.2023	12.835,92
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	2.556.242	CHF	-2.305.500	09.11.2023	20.539,05
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.334	AUD	-2.100	09.11.2023	3,75
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.845.858	EUR	-1.750.100	09.11.2023	-4.674,55
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	13.154	AUD	-20.800	09.11.2023	-19,13
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	13.970	AUD	-22.100	09.11.2023	-26,90
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	499.588	EUR	-472.400	09.11.2023	77,44
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	15.079	EUR	-14.300	09.11.2023	-41,88
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	393.972	AUD	-617.000	24.11.2023	3.029,06
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	28.112.500	USD	-31.658.435	24.11.2023	-690.294,99
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	34.627.100	USD	-36.661.878	24.11.2023	-24.917,66
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
AUD	17.934.200	USD	-11.325.896	24.11.2023	37.500,22
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					3.738.216,87

Swapkontrakte

Art		Verbindlichkeiten			Forderungen		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>		<i>Nennwert</i>			<i>Nennwert</i>			<i>(in USD)</i>
IRS	USD	10.000.000	1,97	USD	10.000.000	Zero Coupon/US Inflation - Interpolated - Maturity	15/12/2025	1.243.464,4
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	USD	5.000.000	2,0425	USD	5.000.000	Zero Coupon/US Inflation - Interpolated - Maturity	15/12/2027	639.939,13
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	4.500.000	2,3192	EUR	4.500.000	Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15/01/2028	44.320,07
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten								1.927.723,6

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		306.660.741,41			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		10.465.703,68			
Forderungen aus Erträgen		985.236,40			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten		1.927.723,60			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		3.738.216,87			
		323.777.621,96			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		4.457.226,92			
Andere Passiva		168.625,80			
		3.708,47			
		4.629.561,19			
Nettovermögen		319.148.060,77			
Teilfondsentwicklung					
		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	319.148.060,77	490.407.527,12	1.069.899.917,03	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	111,17	110,74	116,95	
B - Thesaurierend	USD	111,57	111,14	117,36	
EB - Thesaurierend	USD	165,08	163,44	171,52	
IB - Thesaurierend	USD	1.154,12	1.144,53	1.203,16	
MB - Thesaurierend	USD	985,62	1.134,33	1.189,00	
UA - Ausschüttend	USD	111,84	111,29	117,28	
UB - Thesaurierend	USD	114,55	113,71	119,66	
EAH - Ausschüttend	AUD	93,22	94,19	/	
EBH - Thesaurierend	CHF	124,61	128,76	137,87	
AH - Ausschüttend	EUR	94,60	96,58	103,80	
BH - Thesaurierend	EUR	94,86	96,85	104,09	
EBH - Thesaurierend	EUR	139,29	141,33	150,96	
IBH - Thesaurierend	EUR	1.007,43	1.023,80	1.095,38	
UAH - Ausschüttend	EUR	95,62	97,44	104,44	
UBH - Thesaurierend	EUR	97,70	99,40	106,46	
Anzahl der Aktien im Umlauf					
		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	18.741,827	32.832,634	750,000	14.840,807
B - Thesaurierend	USD	260.532,496	386.791,140	739,112	126.997,756
EB - Thesaurierend	USD	493.942,963	597.674,953	142.542,337	246.274,327
IB - Thesaurierend	USD	1.630,313	14.879,061	0,000	13.248,748
MB - Thesaurierend	USD	47.110,000	53.781,717	47.110,000	53.781,717
UA - Ausschüttend	USD	3.483,266	8.107,784	0,000	4.624,518
UB - Thesaurierend	USD	21.358,156	45.585,100	1.120,000	25.346,944
EAH - Ausschüttend	AUD	389.001,000	473.003,000	28.372,000	112.374,000
EBH - Thesaurierend	CHF	432.764,806	660.373,858	86.012,578	313.621,630
AH - Ausschüttend	EUR	70.548,655	88.750,618	0,000	18.201,963
BH - Thesaurierend	EUR	203.898,342	275.758,492	34.184,223	106.044,373
EBH - Thesaurierend	EUR	277.091,790	661.824,953	106.138,230	490.871,393
IBH - Thesaurierend	EUR	523,872	6.986,130	940,050	7.402,308
UAH - Ausschüttend	EUR	6.261,456	22.826,780	1.020,000	17.585,324
UBH - Thesaurierend	EUR	34.930,836	121.552,510	1.109,680	87.731,354

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	490.407.527,12
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	4.589.631,48
Bankzinsen	180.704,78
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	63.107,19
	4.833.443,45
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.735.991,58
Depotbank- und Depotgebühr	240.131,79
Zentralverwaltungsvergütung	292.347,03
Druck- und Veröffentlichungskosten	32.596,89
Zinsen und Bankspesen	32.811,23
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a. *	456.614,37
"Taxe d'abonnement"	76.127,35
	2.866.620,24
Nettoerträge (-verluste)	1.966.823,21
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-8.245.164,64
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	4.482.488,24
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	18.897.411,85
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-3.153.375,92
	11.981.359,53
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	13.948.182,74
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	20.299.036,80
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-4.571.254,35
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-9.556.785,94
	6.170.996,51
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	20.119.179,25
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	105.829.793,00
Rücknahmen	-297.070.658,22
	-191.240.865,22
Ausschüttung	-137.780,38
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	319.148.060,77

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Kosten für Absicherung und Broker gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	59,39
Frankreich	8,53
Grossbritannien	7,50
Japan	5,31
Italien	3,85
Spanien	2,22
Australien	1,85
Kanada	1,66
Deutschland	1,56
Neuseeland	1,54
Niederlande	1,09
Supranational	0,64
Schweden	0,50
Finnland	0,45
Total	96,09

Wirtschaftliche Aufteilung

Länder und Zentralregierungen	83,39
Banken und andere Kreditinstitute	7,55
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	1,93
Gesundheits- und Sozialdienste	0,86
Grafikverlags- und Druckmedien	0,81
Supranationale Organisationen	0,64
Computerhardware und Netzwerk	0,60
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	0,32
Total	96,09

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD ANZ NEW ZEALAND INTL/LDN 1.25%/21-220626	3.000.000	2.665.500,00	0,84
AUD AUSTRALIAN GOVERNMENT I/L 0.75%/17-21.11.2027	1.797.000	1.323.814,80	0,41
AUD AUSTRALIAN GOVERNMENT S. -CAIN407- I/L 3%/09.20.09.2025	500.000	467.699,31	0,15
AUD AUSTRALIAN GOVERNMENT S. -TI408- I/L 2.5%/10.20.09.2030	1.781.000	1.628.970,05	0,51
USD BANK OF NY MELLON CORP SJ 2.11%/19-241024	1.000.000	964.410,00	0,30
USD BNP PARIBAS 3.375%/18-090125	1.500.000	1.449.885,00	0,45
EUR BRD I/L 0.5%/12-150430	1.490.000	1.973.870,24	0,62
EUR BUIONI POLIENNALI 0.1%/22-150633	1.800.000	1.734.622,40	0,54
EUR BUIONI POLIENNALI DEL TES 0%/21-010426	2.220.000	2.145.230,33	0,67
EUR BUIONI POLIENNALI DEL TES I/L 0.65%/20-15.05.2026	1.500.000	1.814.406,70	0,57
EUR BUIONI POLIENNALI DEL TES I/L -144A-0.4%/19-15.05.2030	3.036.000	3.417.561,13	1,07
USD CANADIAN IMPERIAL BANK 2.25%/20-280125	1.000.000	955.350,00	0,30
USD CITIGROUP 3.4%/16-010526	1.000.000	940.530,00	0,29
USD CITIGROUP 3.7%/16-120126	750.000	713.895,00	0,22
USD COMCAST 3.375%/15-15.08.2025	2.700.000	2.599.857,00	0,81
USD COOPERAT RABOBANK 5%/23-130125	3.500.000	3.468.995,00	1,09
EUR CORP ANDINA DE FOMENTO 1.625%/20-03.06.2025	2.000.000	2.029.059,48	0,64
EUR CPPIB CAPITAL INC 0.25%/20-06.04.2027	2.500.000	2.376.320,98	0,74
EUR DEUTSCHLAND I/L BOND I/L 0.1%/19-01.03.2029	2.500.000	3.015.765,68	0,94
EUR FRANCE (GOVT OF) I/L 0.1%/19-01.03.2029	2.035.390	2.473.744,92	0,78
EUR FRANCE (GOVT OF) I/L 0.1%/21-010332	3.200.000	3.598.658,96	1,13
EUR FRANCE (GOVT OF) I/L 1.444 0.1%/21-250731	3.370.000	3.987.615,22	1,25
EUR FRANCE OAT I/L 0.1%/16-01.03.2028	4.450.000	5.374.993,30	1,68
EUR FRANCE OAT I/L 0.1%/14-25.07.2030	2.802.667	3.663.616,30	1,15
EUR FRANCE OAT I/L 1.85%/10-25.07.2027	2.000.000	2.916.856,75	0,91
EUR FRANCE OAT I/L 3.15%/02-25.07.2032	900.000	1.725.983,56	0,54
EUR FRANCE OAT I/L 3.4%/09-25.07.2029	1.135.639	2.032.397,72	0,64
USD GOLDMAN SACHS GROUP 3.75%/15-220525	1.770.000	1.706.811,00	0,53
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC 2%/18-011128	1.300.000	1.247.449,20	0,39
EUR IBM CORP 3.375%/23-060227	1.850.000	1.928.523,45	0,60
EUR ITALY BTP I/L 1.3%/16-15.05.2028	2.497.000	3.164.822,55	0,99
JPY JAPAN N. -19- I/L 0.1%/14-10.09.2024	48.400.000	352.112,68	0,11
JPY JAPAN N. -20- I/L 0.1%/15-10.03.2025	924.800.000	6.796.719,34	2,13
JPY JAPAN N. -21- I/L 0.1%/16-10.03.2026	556.900.000	4.129.512,48	1,29
JPY JAPAN N. -22- I/L 0.1%/17-10.03.2027	256.300.000	1.952.516,63	0,61
JPY JAPAN S. -18- I/L 0.1%/14-10.03.2024	364.500.000	2.709.343,67	0,85
USD JP MORGAN CHASE 3.9%/15-150725	2.700.000	2.616.894,00	0,82
EUR JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/19-11.03.2027	1.500.000	1.472.438,00	0,46
EUR MORGAN STANLEY 1.875%/17-27.04.2027	1.000.000	979.691,02	0,31
EUR NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.25%/16-180526	2.500.000	2.492.088,90	0,78
NZD NEW ZEALAND GVT ILB I/L 2%/12-20.09.2025	1.441.000	1.068.823,52	0,33
NZD NEW ZEALAND GVT ILB I/L 3%/13-20.09.2030	1.599.000	1.185.225,28	0,37
EUR NORDEA BANK AB 1.125%/17-27.09.2027	1.500.000	1.444.009,98	0,45
USD ROYAL BANK OF CANADA 4.875%/23-120126	2.000.000	1.957.480,00	0,61
EUR SPAIN I/L BOND I/L 16-30.11.2027	2.000.000	2.551.674,44	0,80
EUR SPAIN I/L BOND I/L -144A- 1%/15-30.11.2030	3.564.000	4.540.109,15	1,42
USD STATE STREET CORP 2.65%/16-190526	3.000.000	2.793.810,00	0,88
SEK SWEDEN I/L 0.125%/15-01.06.2026	2.220.000	249.436,43	0,08
SEK SWEDEN I/L BOND I/L -144A- 0.125%/20-01.06.2030	6.050.000	732.183,24	0,23
SEK SWEDEN S. 3104 I/L 3.5%/98-01.12.2028	3.985.000	626.619,05	0,20
EUR TAKEDA PHARMAC CO LTD 2.25%/18-211126	1.000.000	1.006.781,93	0,32
GBP TSY 0 1/8% 2028 I/L GILT I/L 0.125%/18-10.08.2028	2.607.518	4.170.923,91	1,31
GBP TSY 0 1/8% I/L GILT I/L 0.125%/21-100831	1.031.706	1.543.940,85	0,48
USD TSY INFL S A-2031 I/L 0.125%/21-150131	6.000.000	5.970.054,38	1,87
USD TSY INFL D-2032 I/L 0.625%/22-150732	8.000.000	7.296.280,38	2,27
USD TSY INFL IX N/B I/L 0.125%/20-150730	6.392.000	6.559.091,08	2,06
USD TSY INFL IX N/B I/L 0.125%/21-151026	7.509.000	7.844.104,19	2,46
USD TSY INFL IX N/B I/L 0.125%/22-150132	17.070.400	15.580.887,12	4,88
USD TSY INFL IX N/B S A-2033 I/L 1.125%/23-1	13.000.000	11.866.389,62	3,72
USD TSY INFL IX N/B S D-2031 I/L 0.125%/21-150731	12.438.600	11.926.407,55	3,74
USD TSY INFL IX N/B S X-2028 I/L 1.25%/23-15	9.000.000	8.708.759,93	2,73
USD TSY INFL IX N/B S. -A-2029- I/L 0.875%/19-15.01.2029	9.601.100	10.750.905,71	3,37
USD TSY INFL IX N/B S. -A-2030- I/L 0.125%/20-15.01.2030	10.058.100	10.357.679,99	3,25
USD TSY INFL IX N/B S. -D-2028- I/L 0.75%/18-15.07.2028	7.334.000	8.300.178,29	2,60
USD TSY INFL IX N/B S. -D-2029- I/L 0.25%/19-15.07.2029	8.252.800	8.765.350,05	2,75
USD TSY INFL S 2X-2026 I/L 0.125%/21-150426	400.000	437.994,37	0,14
GBP UK TSY 0 1/4% 2031 0.25%/20-310731	2.000.000	1.771.507,97	0,56
GBP UNITED KINGDOM I/L 0.125%/11-22.03.2029	2.000.000	3.734.919,72	1,17
GBP UNITED KINGDOM I/L 0.125%/15-22.03.2026	718.761	1.252.928,61	0,39
GBP UNITED KINGDOM I/L 1.25%/06-22.11.2027	2.000.000	4.833.864,60	1,51
GBP UNITED KINGDOM I/L 1.25%/08-22.11.2032	1.000.000	2.196.443,22	0,69
GBP UNITED KINGDOM I/L 4.125%/92-22.07.2030	1.087.980	4.428.467,05	1,39
USD UNITEDHEALTH GROUP 2.95%/17-151027	3.000.000	2.731.230,00	0,86
USD US I/L 2.5%/09-15.01.2029	2.750.000	3.925.707,66	1,23
USD US I/L 0.375%/17-15.01.2027	6.885.000	8.127.169,39	2,55
USD US I/L 1.75%/08-15.01.2028	3.481.000	4.928.595,29	1,54
USD US I/L 2.375%/07-15.01.2027	1.368.700	2.061.651,21	0,65
USD US I/L 3.625%/98-15.04.2028	4.273.600	8.460.775,48	2,65
USD US I/L 3.875%/99-15.04.2029	2.000.000	3.980.707,66	1,25

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettvermö- gens
USD US TREASURY I/L 0.125%/16-15.07.2026	1.000.000	1.198.095,50	0,38
USD US TREASURY I/L 0.375%/17-15.07.2027	8.453.300	9.813.040,86	3,07
USD US TREASURY I/L 0.5%/18-15.01.2028	5.729.300	6.544.404,62	2,05
USD US TREASURY N/B S E-2032 2.75%/22-150832	6.500.000	5.499.609,38	1,72
Total Anleihen		306.660.741,41	96,09
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		306.660.741,41	96,09
Total des Wertpapierbestandes		306.660.741,41	96,09
Bareinlagen bei Banken und Brokern		10.465.703,68	3,28
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-4.457.226,92	-1,40
Andere Nettvermögenswerte		6.478.842,60	2,03
Teilfondsvermögen		319.148.060,77	100,00

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

Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	38689111	LU1699964828	0,80%	1,06%
B - Thesaurierend	USD	10670981	LU0458985636	0,80%	1,06%
DA - Ausschüttend	USD	49408652	LU2039695544	0,00%	0,12%
DB - Thesaurierend	USD	3679009	LU0340000420	0,00%	0,12%
EB - Thesaurierend	USD	3679006	LU0340000263	0,50%	0,72%
IA - Ausschüttend	USD	38689163	LU1699965718	0,50%	0,76%
IB - Thesaurierend	USD	23727978	LU1034382256	0,50%	0,76%
UA - Ausschüttend	USD	38689175	LU1699966872	0,60%	0,85%
UB - Thesaurierend	USD	38689179	LU1699967250	0,60%	0,85%
DBH - Thesaurierend	CHF	23143261	LU1007181891	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	CHF	3679019	LU0340001154	0,30%	0,60%
IBH - Thesaurierend	CHF	23729088	LU1034382330	0,30%	0,63%
UAH - Ausschüttend	CHF	38689176	LU1699966955	0,40%	0,74%
AH - Ausschüttend	EUR	38689158	LU1699965122	0,60%	0,94%
BH - Thesaurierend	EUR	10670983	LU0458985800	0,60%	0,94%
DBH - Thesaurierend	EUR	3679015	LU0340000776	0,00%	0,15%
EBH - Thesaurierend	EUR	3679016	LU0340000933	0,30%	0,60%
IBH - Thesaurierend	EUR	23729139	LU1034382413	0,30%	0,64%
UAH - Ausschüttend	EUR	38689177	LU1699967094	0,40%	0,74%
UBH - Thesaurierend	EUR	38689181	LU1699967417	0,40%	0,73%
IBH - Thesaurierend	GBP	23729148	LU1034382504	0,35%	0,69%

Für die Aktienklassen -DA-, -DB- und -DBH- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	5,01%	/	-3,45%	2,18%	3,54%
B - Thesaurierend	USD	5,01%	/	-3,46%	2,18%	3,52%
DA - Ausschüttend	USD	5,93%	/	-2,44%	3,16%	4,52%
DB - Thesaurierend	USD	5,93%	/	-2,44%	3,16%	4,57%
EB - Thesaurierend	USD	5,31%	/	-3,14%	2,54%	3,89%
IA - Ausschüttend	USD	5,27%	/	-3,17%	2,50%	3,84%
IB - Thesaurierend	USD	5,27%	/	-3,18%	2,50%	3,84%
UA - Ausschüttend	USD	5,18%	/	-3,27%	2,39%	3,75%
UB - Thesaurierend	USD	5,19%	/	-3,27%	2,40%	3,74%
DBH - Thesaurierend	CHF	2,45%	-1,22%	-4,73%	/	/
EBH - Thesaurierend	CHF	1,96%	/	-5,27%	1,70%	2,06%
IBH - Thesaurierend	CHF	1,94%	/	-5,31%	1,68%	2,01%
UAH - Ausschüttend	CHF	1,85%	/	-5,42%	1,55%	1,94%
AH - Ausschüttend	EUR	3,33%	/	-5,33%	1,51%	1,92%
BH - Thesaurierend	EUR	3,34%	/	-5,31%	1,50%	1,89%
DBH - Thesaurierend	EUR	4,11%	/	-4,47%	2,32%	2,69%
EBH - Thesaurierend	EUR	3,62%	/	-5,00%	1,85%	2,25%
IBH - Thesaurierend	EUR	3,60%	/	-5,04%	1,81%	2,19%
UAH - Ausschüttend	EUR	3,50%	/	-5,14%	1,70%	2,13%
UBH - Thesaurierend	EUR	3,50%	/	-5,13%	1,71%	2,09%
IBH - Thesaurierend	GBP	4,85%	/	-3,59%	2,35%	2,77%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	06.12.2022	0,76
A - Ausschüttend	USD	07.03.2023	0,91
A - Ausschüttend	USD	06.06.2023	0,78
A - Ausschüttend	USD	05.09.2023	0,89
DA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	10,36
DA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	12,13
DA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	10,22
DA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	11,52
IA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	0,83
IA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	0,99
IA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	0,85
IA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	0,96
UA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	0,81
UA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	0,96
UA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	0,83
UA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	0,94

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

UAH - Ausschüttend	CHF	06.12.2022	0,81
UAH - Ausschüttend	CHF	07.03.2023	0,78
UAH - Ausschüttend	CHF	06.06.2023	0,71
UAH - Ausschüttend	CHF	05.09.2023	0,80
AH - Ausschüttend	EUR	06.12.2022	0,75
AH - Ausschüttend	EUR	07.03.2023	0,74
AH - Ausschüttend	EUR	06.06.2023	0,69
AH - Ausschüttend	EUR	05.09.2023	0,80
UAH - Ausschüttend	EUR	06.12.2022	0,79
UAH - Ausschüttend	EUR	07.03.2023	0,78
UAH - Ausschüttend	EUR	06.06.2023	0,73
UAH - Ausschüttend	EUR	05.09.2023	0,85

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
EUR	9.350.000	USD	-9.872.280	08.11.2023	13.895,97
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
GBP	2.000.000	USD	-2.434.542	08.11.2023	-7.480,00
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	4.100.000	USD	-4.344.081	08.11.2023	-8.966,70
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	500.000	USD	-528.753	08.11.2023	-80,50
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	500.000	USD	-529.124	08.11.2023	-451,70
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
EUR	2.200.000	USD	-2.316.789	08.11.2023	9.369,80
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	3.300.000	USD	-3.524.866	08.11.2023	-35.627,79
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	4.500.000	USD	-4.804.592	08.11.2023	-46.539,45
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
EUR	100.000	USD	-108.393	08.11.2023	-2.658,70
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	167.095.232	EUR	-153.900.000	08.11.2023	4.368.410,77
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	10.337.550	GBP	-8.100.000	08.11.2023	507.927,19
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	4.700.000	USD	-4.957.997	08.11.2023	11.524,40
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	58.806	CHF	-52.800	09.11.2023	733,74
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	30.193	GBP	-24.900	09.11.2023	-24,56
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	45.200	USD	-47.664	09.11.2023	129,82
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	147.001	EUR	-139.000	09.11.2023	24,18
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	14.073	CHF	-12.600	09.11.2023	214,71
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	549.839	EUR	-521.200	09.11.2023	-1.271,25
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	31.952.100	USD	-33.729.982	09.11.2023	55.785,17
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					<i>(In USD)</i>
CHF	14.283.200	USD	-15.702.735	09.11.2023	6.513,87
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
GBP	1.125.200	USD	-1.373.044	09.11.2023	-7.571,47
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	66.743	CHF	-59.500	09.11.2023	1.301,33
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	13.886	EUR	-13.100	09.11.2023	34,34
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	18.089	EUR	-17.100	09.11.2023	8,05
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	4.183.434	EUR	-3.946.100	09.11.2023	10.871,47
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	5.200	USD	-5.510	09.11.2023	-11,12
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	1.125.300	USD	-1.363.098	24.11.2023	2.615,19
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	30.731.400	USD	-32.537.257	24.11.2023	-22.114,32
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	13.845.000	USD	-15.591.322	24.11.2023	-339.960,30
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					4.516.602,14

Swapkontrakte

Art		Verbindlichkeiten			Forderungen		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>		<i>Nennwert</i>			<i>Nennwert</i>			<i>(in USD)</i>
IRS	USD	30.000.000	4,9767	USD	30.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	10/07/2025	99.793,08
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	6.000.000	1,5532	EUR	6.000.000	6M / EURIBOR	22/07/2025	263.782,43
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	USD	29.000.000	4,7192	USD	29.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	25/07/2025	228.901,51
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	8.000.000	3,8052	EUR	8.000.000	6M / EURIBOR	28/07/2025	-13.725,32
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	5.000.000	3,7497	EUR	5.000.000	6M / EURIBOR	31/07/2025	-2.933,43
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	GBP	2.000.000	5,1335	GBP	2.000.000	1D/GBP-SONIA-OIS-COMPOUND	16/10/2025	-6.493,49
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	15.000.000	3,0902	EUR	15.000.000	6M / EURIBOR	22/12/2025	-47.414,51
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	USD	5.000.000	4,2902	USD	5.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	25/07/2026	76.615,94
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	EUR	6.000.000	3,5437	EUR	6.000.000	6M / EURIBOR	25/07/2026	-12.640,68
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	USD	9.000.000	4,3952	USD	9.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	28/07/2026	110.725,37
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								
IRS	USD	6.000.000	4,4032	USD	6.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	01/08/2026	71.634,39
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>								

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

Art	Verbindlichkeiten		Forderungen		Fälligkeit	Bewertung (in USD)	
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert				
IRS GBP	2.000.000	4,8859	GBP	2.000.000	1D/GBP-SONIA-OIS-COMPOUND	16/10/2026	-8.015,13
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	38.000.000	3,6072	USD	38.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	21/12/2026	1.673.679,89
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	11.000.000	2,9517	EUR	11.000.000	6M / EURIBOR	21/12/2026	7.283,27
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	8.000.000	3,0122	EUR	8.000.000	6M / EURIBOR	22/12/2026	-13.067,42
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	18.000.000	3,6617	USD	18.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	22/12/2026	755.832,1
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	10.000.000	2,9027	EUR	10.000.000	6M / EURIBOR	21/12/2027	36.715,67
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	8.000.000	2,9727	EUR	8.000.000	6M / EURIBOR	22/12/2027	2.756,74
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	4.000.000	3,3162	EUR	4.000.000	6M / EURIBOR	01/03/2028	-74.410,92
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	3.000.000	3,9907	USD	3.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	01/03/2028	94.463,92
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	2.000.000	- 0,0393	EUR	2.000.000	6M / EURIBOR	24/05/2028	327.535,43
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	5.000.000	3,6322	USD	5.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	12/06/2028	228.203,93
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	4.000.000	3,1122	EUR	4.000.000	6M / EURIBOR	12/06/2028	38.544,55
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	2.000.000	3,2667	EUR	2.000.000	6M / EURIBOR	22/06/2028	5.053,08
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	3.000.000	-0,1958	EUR	3.000.000	6M / EURIBOR	20/07/2028	510.596,97
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	3.000.000	3,2512	EUR	3.000.000	6M / EURIBOR	25/07/2028	7.948,22
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	2.500.000	3,9507	USD	2.500.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	28/07/2028	75.461,68
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	2.000.000	3,2542	EUR	2.000.000	6M / EURIBOR	28/07/2028	4.583,72
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	2.000.000	3,9842	USD	2.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	01/08/2028	57.113,61
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	3.000.000	2,6772	USD	3.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	22/08/2028	258.468,14
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	2.000.000	4,6942	USD	2.000.000	1D/USD-SOFR-OIS-COMPOUND	23/10/2028	-10.799,07
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	5.000.000	2,9417	EUR	5.000.000	6M / EURIBOR	22/12/2028	19.356,45
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten						4.765.550,12	

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		337.852.448,66			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		5.993.751,24			
Forderungen aus Erträgen		3.738.686,61			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten		4.765.550,12			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		4.516.602,14			
		356.867.038,77			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		4.622.144,50			
Andere Passiva		127.645,82			
		10,50			
		4.749.800,82			
Nettovermögen		352.117.237,95			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	352.117.237,95	497.347.346,44	603.289.950,75	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	99,02	95,29	103,11	
B - Thesaurierend	USD	114,24	106,26	112,68	
DA - Ausschüttend	USD	992,73	955,24	1.033,22	
DB - Thesaurierend	USD	1.240,33	1.141,01	1.198,16	
EB - Thesaurierend	USD	147,27	136,52	144,28	
IA - Ausschüttend	USD	99,11	95,37	103,19	
IB - Thesaurierend	USD	119,07	110,42	116,74	
UA - Ausschüttend	USD	99,14	95,41	103,23	
UB - Thesaurierend	USD	115,62	107,33	113,58	
DBH - Thesaurierend	CHF	987,78	946,97	1.012,48	
EBH - Thesaurierend	CHF	114,71	110,66	118,90	
IBH - Thesaurierend	CHF	96,52	93,14	100,10	
UAH - Ausschüttend	CHF	84,55	84,69	93,37	
AH - Ausschüttend	EUR	87,14	85,69	94,52	
BH - Thesaurierend	EUR	101,32	96,29	103,70	
DBH - Thesaurierend	EUR	1.078,36	1.015,08	1.084,38	
EBH - Thesaurierend	EUR	125,52	118,89	127,62	
IBH - Thesaurierend	EUR	100,95	95,64	102,71	
UAH - Ausschüttend	EUR	87,24	85,79	94,65	
UBH - Thesaurierend	EUR	102,55	97,26	104,55	
IBH - Thesaurierend	GBP	110,86	103,52	109,66	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	163.985,329	297.019,180	30,000	133.063,851
B - Thesaurierend	USD	136.314,475	331.587,723	34.781,008	230.054,256
DA - Ausschüttend	USD	4.969,204	8.339,513	0,000	3.370,309
DB - Thesaurierend	USD	115.498,720	159.745,447	3.173,649	47.420,376
EB - Thesaurierend	USD	94.276,120	131.308,177	3.100,000	40.132,057
IA - Ausschüttend	USD	264.938,791	370.672,346	31.827,535	137.561,090
IB - Thesaurierend	USD	240.760,811	295.416,507	0,000	54.655,696
UA - Ausschüttend	USD	12.598,242	40.370,280	1.973,261	29.745,299
UB - Thesaurierend	USD	60.070,441	197.387,905	2.253,259	139.570,723

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
DBH - Thesaurierend	CHF	12.590,372	14.675,000	40,372	2.125,000
EBH - Thesaurierend	CHF	100.737,226	135.231,881	855,387	35.350,042
IBH - Thesaurierend	CHF	18.073,196	35.067,839	0,000	16.994,643
UAH - Ausschüttend	CHF	27.204,726	39.809,726	580,000	13.185,000
AH - Ausschüttend	EUR	19.189,192	42.603,571	1.034,000	24.448,379
BH - Thesaurierend	EUR	129.251,312	160.766,139	9.660,390	41.175,217
DBH - Thesaurierend	EUR	17.505,921	22.199,921	6.513,085	11.207,085
EBH - Thesaurierend	EUR	124.042,528	250.816,942	21.499,268	148.273,682
IBH - Thesaurierend	EUR	20.640,497	116.895,842	0,000	96.255,345
UAH - Ausschüttend	EUR	15.198,437	20.324,807	0,000	5.126,370
UBH - Thesaurierend	EUR	55.090,492	108.942,628	297,682	54.149,818
IBH - Thesaurierend	GBP	20.148,886	27.389,761	802,175	8.043,050

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	497.347.346,44
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	15.476.747,90
Dividenden (Netto)	30,45
Bankzinsen	501.972,25
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	196.801,40
	16.175.552,00
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.317.069,45
Depotbank- und Depotgebühr	247.484,70
Zentralverwaltungsvergütung	155.249,96
Druck- und Veröffentlichungskosten	28.096,93
Zinsen und Bankspesen	4.627,99
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a. *	613.126,81
"Taxe d'abonnement"	86.217,59
	2.451.873,43
Nettoerträge (-verluste)	13.723.678,57
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-19.046.326,81
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	33.667.430,02
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	4.610.516,14
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-458.582,46
	18.773.036,89
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	32.496.715,46
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	41.825.861,97
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-28.136.482,17
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-3.548.391,90
	10.140.987,90
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	42.637.703,36
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	23.275.593,28
Rücknahmen	-208.529.918,81
	-185.254.325,53
Ausschüttung	-2.613.486,32
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	352.117.237,95

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Kosten für Absicherung und Broker gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes**Geographische Aufteilung**

Vereinigte Staaten	28,80
Grossbritannien	10,90
Niederlande	10,22
Frankreich	6,84
Deutschland	5,21
Spanien	4,81
Irland	4,52
Italien	3,29
Belgien	2,80
Österreich	2,29
Luxemburg	1,81
Portugal	1,76
Mexiko	1,63
Dänemark	1,62
Schweiz	1,44
Japan	1,29
Schweden	1,13
Britische Jungferninseln	1,10
Indonesien	1,08
Norwegen	0,97
Supranational	0,93
Kolumbien	0,82
Australien	0,67
Total	95,95

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	41,23
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	27,98
Länder und Zentralregierungen	4,18
Edelmetalle und Edelsteine	3,10
Telekommunikation	2,70
Chemie	2,61
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,88
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,66
Gesundheits- und Sozialdienste	1,55
Energie- und Wasserversorgung	1,42
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,12
Supranationale Organisationen	0,93
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,87
Petroleum	0,82
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,80
Verpackungsindustrie	0,76
Versicherungsgesellschaften	0,67
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,56
Elektrische Geräte und Komponenten	0,40
Verschiedene Konsumgüter	0,39
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,32
Total	95,95

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
EUR ABN AMRO BANK NV SUB FF FRN/20-PERPET	2.000.000	1.938.368,88	0,55
USD ABN AMRO REG S 4.8%/16-180426	2.000.000	1.906.200,00	0,54
USD AFRICA FINANCE CORP 3.125%/20-16.06.2025	3.500.000	3.262.910,00	0,93
EUR AIB GROUP PLC FF FRN/22-040726	3.000.000	3.124.830,24	0,89
EUR AIB GROUP PLC SUB FF FRN/19-191129	2.000.000	2.017.665,02	0,57
EUR AMCO SPA 2.25%/20-17.07.2027	3.000.000	2.892.681,33	0,82
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL 4%/17-110927	4.000.000	3.710.560,00	1,05
EUR ARKEMA SUB FF FRN/19-PERPET	3.000.000	3.076.472,49	0,87
EUR AT&T INC SUB FF FRN/20-PERPET	2.000.000	1.991.134,32	0,57
USD BANCO BILBAO FF FRN/22-140926	4.000.000	3.941.800,00	1,12
EUR BANCO COMERC PORTUGUES FIX-TO-FRN FRN/21-12.02.2027	4.000.000	3.832.935,68	1,09
EUR BANCO DE SABADELL FF FRN/23-PERPET	1.400.000	1.455.176,13	0,41
EUR BANCO DE SABADELL SA FF FRN/23-070229	2.000.000	2.092.120,10	0,59
USD BANCO SANTANDER MEXICO 5.375%/20-17.04.2025	2.000.000	1.965.500,00	0,56
USD BANK OF AMERICA FF 3.705%/17-240428	3.000.000	2.742.450,00	0,78
USD BANK OF IRELAND FF FRN/22-160926	3.000.000	2.973.630,00	0,84
USD BANK OF IRELAND GROUP FF FRN/21-300927	2.500.000	2.181.800,00	0,62
USD BARCLAYS PLC FF FRN/22-090826	4.000.000	3.904.400,00	1,11
EUR BAYER AG FRN/23-250983	2.300.000	2.415.273,54	0,69
USD BAYER US FINANCE II LLC 4.25%/18-151225	2.000.000	1.922.880,00	0,55
EUR BEVCO LUX SARL 1.5%/20-16.09.2027	3.500.000	3.347.307,60	0,95
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	3.000.000	2.982.801,15	0,85
EUR CAIXABANK SA FF FRN/23-160527	3.000.000	3.170.651,19	0,90
EUR CELANESE US 4.777%/22-190726	3.000.000	3.149.722,59	0,89
USD CELANESE US 6.05%/22-150325	541.000	539.496,02	0,15
EUR CELLNEX FINANCE CO SA 1%/21-150927	3.000.000	2.741.868,57	0,78
EUR CEPXA FINANCE SA 2.25%/20-13.02.2026	3.500.000	3.535.020,23	1,00
USD CITIGROUP 4.45%/15-29.09.2027	2.500.000	2.311.025,00	0,66
EUR COMMERZBANK S 865 4%/16-230326	2.000.000	2.057.217,96	0,58
EUR COOPERATIVE RABOBANK UA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	2.000.000	1.957.711,98	0,56
USD COOPERATIVE RABOBK UA FF FRN/21-151227	615.000	539.059,80	0,15
USD COOPERATIVE RABOBK UA FF FRN/22-060428	1.500.000	1.368.450,00	0,39
EUR CREDIT AGRICOLE SA SUB FF FRN/20-PERPET	2.000.000	1.812.501,32	0,51
EUR CREDIT SUISSE GROUP AG FF FRN/22-010329	2.000.000	2.344.679,68	0,67
USD CS GROUP REG S 4.282%/17-090128	3.000.000	2.738.580,00	0,78
USD DANSKE BANK A/S FF FRN/20-110926	3.000.000	2.733.780,00	0,78
USD DANSKE BANK A/S FF FRN/22-280325	1.000.000	987.720,00	0,28
USD DANSKE BANK A/S FF FRN/23-090126	2.000.000	1.991.800,00	0,57
USD DEUTSCHE BANK 4.5%/15-010425	1.600.000	1.533.520,00	0,44
USD DEUTSCHE BANK AG NY S - D- FF FRN/241126	2.000.000	1.805.420,00	0,51
EUR DEUTSCHE BANK AG SUB FF FRN/21-PERPET	3.000.000	2.258.830,14	0,64
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2.875%/17-28.06.2027	1.700.000	1.462.766,45	0,42
GBP DNB BANK ASA FF FRN/22-170827	3.000.000	3.424.301,39	0,97
EUR EASYJET FINCO BV 1.875%/21-030328	3.600.000	3.334.078,19	0,95
USD ECOPETROL 5.375%/15-26.06.2026	3.000.000	2.873.970,00	0,82
USD EDP FINANCE BV 3.625%/17-150724	3.000.000	2.948.880,00	0,84
USD ELECTRICITE DE FRANCE 5.7%/23-230528	3.000.000	2.937.360,00	0,83
USD ENEL FINANCE N.V. 4.25%/22-150625	3.000.000	2.916.870,00	0,83
EUR FIDELIDADE COMPA SE SUB FF FRN/21-040931	2.600.000	2.369.030,85	0,67
USD FORD MOTOR CREDIT 2.3%/22-100225	2.700.000	2.551.824,00	0,72
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.744%/190724	3.000.000	3.107.865,39	0,88
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.125%/20-010328	2.000.000	1.819.640,00	0,52
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.375%/20-010828	3.000.000	2.723.850,00	0,77
USD GE HEALTHCARE TECH INC 5.6%/23-151125	2.500.000	2.485.775,00	0,71
USD GE HEALTHCARE TECH INC 5.65%/23-151127	3.000.000	2.971.530,00	0,84
USD GERDAU TRADE 4.875%/17-241027	2.000.000	1.891.120,00	0,54
USD GLENORE FUNDING 4%/15-160426	2.900.000	2.816.335,00	0,80
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLD 5.125%/19-15.05.2024	2.000.000	1.986.900,00	0,56
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC FF FRN/21-100927	2.500.000	2.174.950,00	0,62
EUR GRENKE FINANCE PLC 0.625%/19-090125	3.500.000	3.465.543,62	0,98
USD GSK CONSUMER 3.024%/22-240324	950.000	937.878,00	0,27
USD GSK CONSUMER 3.375%/22-240327	2.000.000	1.845.200,00	0,52
USD HIKMA FINANCE USA LLC 3.25%/20-09.07.2025	3.500.000	3.288.460,00	0,93
USD HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/20-240527	3.500.000	3.083.745,00	0,88
USD HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/21-221124	2.000.000	1.994.160,00	0,57
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 2.5%/21-15.01.2026	2.800.000	2.763.348,92	0,78
EUR INFRASTRUTTURE WIRELESS 1.625%/20-211028	2.000.000	1.855.478,94	0,53
GBP ING GROEP NV FF FRN/22-300826	3.000.000	3.572.976,72	1,01
USD ING GROEP NV SUB FF FRN/19-PERPET	2.000.000	1.758.900,00	0,50
EUR INTESA SANPAOLO SPA FF FRN/23-080328	3.000.000	3.156.508,53	0,90
EUR LB BADEN-WUERTTEMBERG SUB FF FRN/19-PERPET	3.000.000	2.262.266,17	0,64
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC FF FRN/110527	2.000.000	1.771.520,00	0,50
USD LLOYDS BANKING GRP PLC FF FRN/23-070827	2.000.000	1.971.120,00	0,56
EUR LLOYDS BANKING REG S FF 6.375%/14-PERPET	2.000.000	1.976.357,46	0,56
USD MACQUARIE GROUP LTD FF FRN/21-120127	2.653.000	2.372.896,26	0,67
USD MATTEL INC 144A 3.375%/21-010426	1.500.000	1.390.230,00	0,39
USD MICHAEL KORS USA INC 4%/17-01.11.2024	2.000.000	1.955.920,00	0,56
USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP FF FRN/22-190128	2.000.000	1.769.480,00	0,50
USD MORGAN STANLEY S I FF FRN/21-200727	2.500.000	2.195.150,00	0,62
EUR MYLAN 2.25%/16-22.11.2024	2.000.000	2.065.145,46	0,59
USD NATWEST GROUP PLC FF FRN/22-101126	3.800.000	3.866.348,00	1,10
USD NOMURA HOLDINGS INC 1.851%/20-160725	3.000.000	2.790.670,00	0,79
EUR ORANO SA 3.375%/19-230426	2.000.000	2.056.583,76	0,58

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

Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettövermö- gens
USD ORGANON FINANCE 1 144A 4.125%/21-300428	2.500.000	2.183.575,00	0,61
EUR PARKER-HANNIFIN CORP 1.125%/17-010325	3.000.000	3.048.662,82	0,87
EUR PERMANENT TSB GROUP FF FRN/23-300629	2.000.000	2.143.680,56	0,61
EUR PRICELINE GROUP 1,8%/15-03.03.2027	4.000.000	3.954.406,12	1,12
USD PT FREEPORT INDONESIA 4.763%/22-140427	4.000.000	3.792.080,00	1,08
EUR RAIFFEISEN BANK INTL FF FRN/23-260127	3.000.000	3.128.540,31	0,89
EUR RCI BANQUE SA 4.875%/23-140628	3.500.000	3.692.064,01	1,05
EUR ROYAL FRIESLANDCAMPINA SUB FF FRN/20- PER 2.85%/20-10.12.2169	3.000.000	2.847.653,13	0,81
USD SANTANDER USA FF FRN/22-060128	3.000.000	2.587.050,00	0,73
USD SASOL FINANCING USA LLC 4.375%/21-180926	3.000.000	2.644.590,00	0,75
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.875%/18-270324	2.000.000	1.981.840,00	0,56
USD SIGMA ALIMENTOS SA DE CV (REG. -S-) 4.125%/16-02.05.2026	4.000.000	3.773.520,00	1,07
EUR SIGNIFY NV 2.375%/20-110527	1.450.000	1.421.410,26	0,40
EUR SILGAN HOLDINGS INC 2.25%/20-010628	3.000.000	2.691.291,12	0,76
USD SOCIETE GENERALE FF FRN/21-090627	2.000.000	1.757.860,00	0,50
USD SOCIETE GENERALE SA 1.488%/20-14.12.2026	1.000.000	892.130,00	0,25
EUR SOCIETE GENERALE SUB FF FRN/23-PERPET	2.900.000	2.894.103,00	0,82
USD SPRINT SPECTRUM S18 A1 18-200325	3.000.000	1.112.377,50	0,32
USD STELLANTIS FIN US INC 1.711%/21-290127	3.000.000	2.605.140,00	0,74
USD STILLWATER MINING CO 4%/21-161126	3.000.000	2.569.330,00	0,74
USD SUZANO AUSTRIA (REG. -S-) 5.75%/16- 14.07.2026	2.000.000	1.960.600,00	0,56
USD SWEDBANK AB 6.136%/23-120926	4.000.000	3.963.240,00	1,13
EUR TEVA PHARM FNC NL II 7.375%/23-150929	3.150.000	3.377.695,29	0,96
EUR TEVA PHARMACEUTICAL INDU 3.75%/21-090527	2.600.000	2.510.920,41	0,71
USD T-MOBILE USA INC 3.75%/21-150427	4.500.000	4.185.900,00	1,19
EUR TRATON FINANCE LUXEMBRG 0.75%/21-240329	3.500.000	3.030.149,47	0,86
USD UNICREDIT SPA 2.569%/20-220926	4.000.000	3.666.520,00	1,04
EUR UFFJOHN FINANCE BV 1.023%/20-23.06.2024	1.000.000	1.034.707,87	0,29
USD VIATRIS INC 2.3%/21-220627	3.000.000	2.572.170,00	0,73
USD VODAFONE GROUP PLC (SUBORDINATED) FIX- TO-FRN FRN/18-03.10.2078	1.478.000	1.460.441,36	0,41
EUR VOLKSBANK WIEN AG SUB/18-PERPET	3.000.000	2.986.035,57	0,85
USD WARNERMEDIA HOLDING INC 3.788%/23- 150326	5.000.000	4.841.250,00	1,37
USD WELLS FARGO FIX-TO-FRN 17-22.05.2028	3.000.000	2.731.680,00	0,78
USD WI TREAS. NT/BD S E-2033 4%/23-150833	16.000.000	14.728.750,08	4,18
EUR WINTERSHALL DEA S NCB FF FRN/21-PERPET	3.000.000	2.569.049,07	0,73
EUR ZF FINANCE GMBH 3%/20-21.09.2025	2.000.000	2.031.258,04	0,58
EUR ZF FINANCE GMBH 5.75%/23-030826	2.400.000	2.546.008,58	0,72
Total Anleihen		314.116.563,64	89,21
Hypothesen, Asset-Back-Securities			
USD BEAR STEARNS S 2003-6 1A1 FRN 03-250833	1.000.000	2.415,14	0,00
USD FREDDIE MAC S T-63 1A1 FRN 05-250245	10.000	309,24	0,00
Total Hypothesen, Asset-Back-Securities		2.724,38	0,00
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
		314.119.288,02	89,21
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
USD BPCE S.A. 6.6120%/23-191027	5.000.000	4.976.750,00	1,41
USD JSC SEVERSTAL (STEEL CAPITAL) (REG. -S-) SERIE 3 5.9%/10-17.10.2022	1.000.000	0,10	0,00
Total Anleihen		4.976.750,10	1,41
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
		4.976.750,10	1,41
Geldmarktinstrumente			
USD QATAR NATIONAL BANK CD 080124	9.000.000	8.899.407,35	2,53
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CP 300124	10.000.000	9.857.003,19	2,80
Total Geldmarktinstrumente		18.756.410,54	5,33
Total des Wertpapierbestandes		337.852.448,66	95,95
Bareinlagen bei Banken und Brokern		5.993.751,24	1,70
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-4.622.144,50	-1,31
Andere Nettowertmögenswerte		12.893.182,55	3,66
Teilfondsvermögen		352.117.237,95	100,00

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

Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	USD	10671058	LU0458988226	0,90%	1,26%
DA - Ausschüttend	USD	49408393	LU2039695031	0,00%	/
DB - Thesaurierend	USD	23044507	LU1002221247	0,00%	/
FB - Thesaurierend	USD	10020697	LU0417723953	0,45%	0,76%
UA - Ausschüttend	USD	26358769	LU1144398606	0,55%	0,91%
UB - Thesaurierend	USD	26358803	LU1144399083	0,55%	0,90%
AH - Ausschüttend	CHF	21858249	LU0953015418	0,90%	1,35%
BH - Thesaurierend	CHF	10671060	LU0458988655	0,90%	1,34%
FBH - Thesaurierend	CHF	10020804	LU0417724175	0,45%	/
IBH - Thesaurierend	CHF	11645064	LU0536227712	0,45%	0,90%
UAH - Ausschüttend	CHF	26358770	LU1144398788	0,55%	1,00%
UBH - Thesaurierend	CHF	26358807	LU1144399166	0,55%	1,00%
AH - Ausschüttend	EUR	21858251	LU0953015251	0,90%	1,34%
BH - Thesaurierend	EUR	10671063	LU0458988812	0,90%	1,34%
FBH - Thesaurierend	EUR	10020740	LU0417724092	0,45%	0,85%
UAH - Ausschüttend	EUR	26358777	LU1144398861	0,55%	0,99%
UBH - Thesaurierend	EUR	26358816	LU1144399240	0,55%	1,00%

Für die Aktienklassen -DA- und -DB- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund -DB- wurde am 22.12.2022 geschlossen.

Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund -FBH- CHF wurde am 23.02.2023 geschlossen.

Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund -DA- wurde am 03.05.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	USD	2,03%	/	-10,51%	0,18%	6,76%
DA - Ausschüttend	USD	/	/	-9,50%	1,24%	7,80%
DB - Thesaurierend	USD	/	/	/	1,24%	7,89%
FB - Thesaurierend	USD	2,50%	/	-10,08%	0,66%	7,26%
UA - Ausschüttend	USD	2,33%	/	-10,20%	0,52%	7,12%
UB - Thesaurierend	USD	2,32%	/	-10,20%	0,53%	7,12%
AH - Ausschüttend	CHF	-1,46%	/	-13,01%	-0,94%	4,68%
BH - Thesaurierend	CHF	-1,46%	/	-13,00%	-0,94%	4,63%
FBH - Thesaurierend	CHF	/	/	-12,63%	-0,46%	5,12%
IBH - Thesaurierend	CHF	-1,09%	/	-12,62%	-0,49%	5,08%
UAH - Ausschüttend	CHF	-1,17%	/	-12,70%	-0,62%	5,05%
UBH - Thesaurierend	CHF	-1,17%	/	-12,70%	-0,60%	4,99%
AH - Ausschüttend	EUR	0,11%	/	-12,58%	-0,81%	4,95%
BH - Thesaurierend	EUR	0,13%	/	-12,59%	-0,76%	4,86%
FBH - Thesaurierend	EUR	0,53%	/	-12,22%	-0,28%	5,36%
UAH - Ausschüttend	EUR	0,42%	/	-12,29%	-0,46%	5,31%
UBH - Thesaurierend	EUR	0,41%	/	-12,28%	-0,41%	5,22%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
DA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	21,79
UA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	1,51
AH - Ausschüttend	CHF	20.12.2022	0,91
UAH - Ausschüttend	CHF	20.12.2022	1,27
AH - Ausschüttend	EUR	20.12.2022	0,96
UAH - Ausschüttend	EUR	20.12.2022	1,36

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In USD)
USD	77.963	CHF	-70.000	09.11.2023	972,77
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	12.883	CHF	-11.500	09.11.2023	234,76
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	14.312	EUR	-13.500	09.11.2023	36,78
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	25.077	EUR	-23.600	09.11.2023	122,45
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	8.766	CHF	-7.800	09.11.2023	186,71
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	28.684	EUR	-27.200	09.11.2023	-76,95
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	6.982.200	USD	-7.370.704	09.11.2023	12.190,22
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	7.939.900	USD	-8.729.007	09.11.2023	3.621,00
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	6.516.300	USD	-6.899.215	24.11.2023	-4.689,13
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	7.669.000	USD	-8.636.320	24.11.2023	-188.310,26
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	200.000	USD	-221.333	08.12.2023	-670,80
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	400.000	USD	-424.892	08.12.2023	-1.392,92
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
EUR	800.000	USD	-846.832	08.12.2023	165,52
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	150.000	USD	-165.708	08.12.2023	-211,34
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	7.690.448	EUR	-7.150.000	08.12.2023	120.208,04
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.889.803	CHF	-1.670.000	08.12.2023	47.078,62
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-10.534,53

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		39.577.814,52			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.041.137,28			
Forderungen aus Erträgen		238.128,41			
		40.857.080,21			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		36.705,60			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		10.534,53			
Andere Passiva		5,49			
		47.245,62			
Nettovermögen		40.809.834,59			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	40.809.834,59	60.057.698,41	165.488.168,57	
Nettoinventarwert pro Aktie					
B - Thesaurierend	USD	134,48	127,80	147,84	
DA - Ausschüttend	USD	/	921,63	1.080,69	
DB - Thesaurierend	USD	/	1.119,86	1.281,13	
FB - Thesaurierend	USD	171,66	162,25	186,78	
UA - Ausschüttend	USD	100,29	96,44	113,15	
UB - Thesaurierend	USD	116,90	110,71	127,62	
AH - Ausschüttend	CHF	76,31	76,63	91,85	
BH - Thesaurierend	CHF	104,25	103,46	122,33	
FBH - Thesaurierend	CHF	/	132,23	155,70	
IBH - Thesaurierend	CHF	929,03	917,90	1.080,47	
UAH - Ausschüttend	CHF	80,22	80,57	96,60	
UBH - Thesaurierend	CHF	93,55	92,52	109,02	
AH - Ausschüttend	EUR	80,28	79,17	94,71	
BH - Thesaurierend	EUR	112,16	109,30	128,90	
FBH - Thesaurierend	EUR	145,69	141,27	165,92	
UAH - Ausschüttend	EUR	84,37	83,26	99,63	
UBH - Thesaurierend	EUR	98,39	95,55	112,29	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	USD	60.883,880	104.490,755	0,000	43.606,875
DA - Ausschüttend	USD	0,000	4.904,356	0,000	4.904,356
DB - Thesaurierend	USD	0,000	218,000	0,000	218,000
FB - Thesaurierend	USD	73,993	5.745,559	0,000	5.671,566
UA - Ausschüttend	USD	1.380,000	4.468,089	0,000	3.088,089
UB - Thesaurierend	USD	11.009,177	50.708,023	0,000	39.698,846
AH - Ausschüttend	CHF	7.985,556	8.571,599	130,000	716,043
BH - Thesaurierend	CHF	75.512,368	90.714,604	0,000	15.202,236
FBH - Thesaurierend	CHF	0,000	4.545,000	0,000	4.545,000
IBH - Thesaurierend	CHF	1.150,000	1.150,000	0,000	0,000
UAH - Ausschüttend	CHF	22.882,029	24.457,578	0,000	1.575,549
UBH - Thesaurierend	CHF	43.707,991	48.318,393	0,000	4.610,402
AH - Ausschüttend	EUR	26.243,886	31.096,738	7,989	4.860,841
BH - Thesaurierend	EUR	86.521,603	111.902,453	11,457	25.392,307
FBH - Thesaurierend	EUR	1.000,000	3.200,000	0,000	2.200,000

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
UAH - Ausschüttend	EUR	2.991,324	4.765,881	0,000	1.774,557
UBH - Thesaurierend	EUR	12.270,996	15.630,291	0,000	3.359,295

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	60.057.698,41
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.089.157,39
Dividenden (Netto)	52.247,56
Bankzinsen	60.623,27
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14.623,24
	1.216.651,46
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	389.471,18
Depotbank- und Depotgebühr	29.419,13
Zentralverwaltungsvergütung	34.250,95
Druck- und Veröffentlichungskosten	19.174,73
Zinsen und Bankspesen	3.304,80
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a. *	105.002,82
"Taxe d'abonnement"	21.563,23
	602.186,84
Nettoerträge (-verluste)	614.464,62
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.542.184,24
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	2.360.540,30
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-356.834,80
	-1.538.478,74
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-924.014,12
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	6.703.875,02
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-842.256,75
	5.861.618,27
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	4.937.604,15
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	13.007,90
Rücknahmen	-24.013.022,83
	-24.000.014,93
Ausschüttung	-185.453,04
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	40.809.834,59

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Kosten für Absicherung und Sicherheitenmanagement gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	55,55
Luxemburg	11,29
Niederlande	5,57
Schweiz	4,81
Deutschland	4,22
Grossbritannien	4,12
Frankreich	3,74
Italien	2,12
Supranational	1,31
Kaimaninseln	1,20
Mexiko	1,00
Südkorea	0,92
Peru	0,71
Irland	0,37
Spanien	0,05
Brasilien	0,01
Total	96,98

Wirtschaftliche Aufteilung

Länder und Zentralregierungen	40,78
Banken und andere Kreditinstitute	15,13
Anlagefonds	9,65
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	8,62
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	3,31
Immobilien	2,50
Petroleum	2,13
Diverse Dienstleistungen	2,01
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,91
Versicherungsgesellschaften	1,75
Supranationale Organisationen	1,31
Energie- und Wasserversorgung	1,20
Computerhardware und Netzwerk	1,20
Elektronik und Halbleiter	1,05
Baustoffe und Bauindustrie	1,04
Gesundheits- und Sozialdienste	0,96
Chemie	0,93
Edelmetalle und Edelsteine	0,75
Nichteisenmetalle	0,71
Telekommunikation	0,02
Total	96,98

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
USD LYONDELLBASELL INDUSTRIES A	34	3.068,16	0,01
Total Aktien		3.068,16	0,01
Anleihen			
EUR ABN AMRO BANK NV FF 17-PERPET	400.000	354.306,40	0,87
USD AFRICA FINANCE CORP 2.875%/21-280428	650.000	535.086,50	1,31
USD ALLIANZ SE SUB FF FRN/21-PERPET	1.000.000	714.660,00	1,75
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025	1.000.000	961.280,00	2,36
USD BARCLAYS PLC SUB FF FRN/21-PERPET	600.000	412.344,00	1,01
CHF CEMBRA MONEY BANK AG CV 0%/19-090726	600.000	615.113,68	1,51
USD CEMEX SAB DE CV 3.875%/21-11.07.2031	500.000	406.320,00	1,00
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	600.000	587.313,59	1,44
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	600.000	489.342,38	1,20
EUR HELLAS TELECOM 8.5%/05-151013 (MATURED)	756.723	10.015,19	0,02
USD HIDROVIAS INT FIN SARL 4.95%/21-08.02.2031	450.000	347.643,00	0,85
EUR HSBC HOLDINGS REG S FF 4.75%/17-PERPET	600.000	524.134,59	1,28
EUR ILIAD SA 1.875%/21-110228	400.000	363.066,82	0,89
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 2.5%/21-15.01.2026	400.000	394.764,13	0,97
USD ING GROEP NV FF FRN/21-010427	1.000.000	893.280,00	2,19
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-040227	1.000.000	889.450,00	2,18
EUR LB BADEN-WUERTEMBERG SUB FF FRN/19-PERPET	600.000	450.453,23	1,10
EUR LEG IMMOBILIEN AG CV 0.4%/20-300628	200.000	163.674,34	0,40
USD LG CHEM LTD CV 1.25%/23-180728	400.000	375.964,00	0,92
USD MERCEDES BENZ 5.5%/22-271124	500.000	498.370,00	1,22
USD MINERVA LUXEMBOURG SA 4.375%/21-180331	400.000	309.768,00	0,76
USD NESTLE HOLDINGS INC 0.625%/20-150126	1.500.000	1.351.905,00	3,31
USD OXG PETROLEO E GAS REG S 8.5%/11-010618	1.000.000	3.110,00	0,01
USD ON SEMICONDUCTOR CORP 144A 3.875%/010928	500.000	429.740,00	1,05
USD ORGANON FINANCE 1 144A 4.125%/21-300428	500.000	432.715,00	1,06
EUR PAPREC HOLDING S 3.5%/21-010728	500.000	470.375,57	1,15
USD RINGCENTRAL INC CV 0%/20-150326	500.000	416.555,00	1,02
USD SASOL FINANCING USA LLC 4.375%/21-180926	400.000	352.612,00	0,86
USD SEAGATE HDD CAY 9.625%/22-011232	459.000	491.235,57	1,20
USD SIBUR SECURITIES DAC 3.45%/19-23.09.2024	200.000	151.058,00	0,37
USD STILLWATER MINING CO 4.5%/21-161129	400.000	305.452,00	0,75
CHF SWISS PRIME SITE AG CV 0.325%/18-160125	800.000	857.511,10	2,10
USD TELADOC HEALTH INC CV 1.25%/20-010627	500.000	390.365,00	0,96
USD UBS GROUP AG SUB FF FRN/21-PERPET	600.000	488.640,00	1,20
USD US TREASURY N/B 1.75%/19-31.07.2024	5.000.000	4.863.867,20	11,92
USD US TREASURY N/B 3.375%/23-150533	1.000.000	884.453,13	2,17
USD US TREASURY N/B 4.125%/22-151132	1.000.000	942.265,63	2,31
USD US TREASURY N/B S F-31 1.375%/21-151131	1.000.000	767.656,25	1,88
USD US TREASURY N/B S W-2026 0.75%/21-310326	5.000.000	4.529.882,80	11,10
USD US TREASURY N/B S. -Y-2025- 0.375%/20-30.04.2025	5.000.000	4.654.101,55	11,40
EUR VERTICAL MIDCO GMBH 4.375%/20-15.07.2027	200.000	191.889,89	0,47
EUR VMED O2 UK FINANCING I 3.25%/20-310131	400.000	351.317,20	0,86
USD VOLCAN CIA MINERA SAA-CM 4.375%/21-11.02.2026	600.000	290.628,00	0,71
EUR VOLKSWAGEN INTL FIN NV (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	500.000	434.363,58	1,06
EUR WENDEL SE CV 2.625%/23-270326	200.000	202.388,02	0,50
EUR ZF FINANCE GMBH 3%/20-21.09.2025	200.000	203.125,80	0,50
Total Anleihen		34.753.563,14	85,16
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		34.756.631,30	85,17
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Aktien			
EUR ABENGOA B	1.742.590	18.419,18	0,05
Total Aktien		18.419,18	0,05
Anleihen			
EUR ENI SPA CV 0%/23-140930	800.000	864.439,97	2,12
Total Anleihen		864.439,97	2,12
Nicht börsennotierte Wertpapiere		882.859,15	2,16
Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) CONVERT INTERNATIONAL BOND FUND DA USD	5.000	3.938.324,07	9,65
Total Fondsanteile (Open-End)		3.938.324,07	9,65
Total Investmentfonds		3.938.324,07	9,65
Total des Wertpapierbestandes		39.577.814,52	96,98
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.041.137,28	2,55

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Andere Nettovermögenswerte		190.882,79	0,47
Teilfondsvermögen		40.809.834,59	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	38309360	LU1684797787	1,20%	1,40%
BH - Thesaurierend	EUR	38309364	LU1684798249	1,20%	1,40%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	USD	4,43%	/	-12,80%	2,67%	3,00%
BH - Thesaurierend	EUR	2,43%	/	-14,92%	1,88%	1,23%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
USD	5.067	EUR	-4.781	18.12.2023	2,16
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	4.425	EUR	-4.166	18.12.2023	11,16
<i>Barclays Bank PLC Wholesale - London - United Kingdom</i>					
EUR	418.956	USD	-448.597	18.12.2023	-4.772,32
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	4.393	EUR	-4.182	18.12.2023	-36,90
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
USD	45.767	EUR	-42.794	18.12.2023	431,50
<i>Canadian Imperial Bank of Commerce - Toronto - Canada</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-4.364,40

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		6.943.848,34			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		481.746,95			
Forderungen aus Zeichnungen		1,26			
Forderungen aus Erträgen		127.418,02			
Kostenerstattung		1.384,89			
		7.554.399,46			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		8.949,08			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		4.364,40			
		13.313,48			
Nettovermögen		7.541.085,98			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	7.541.085,98	8.708.292,86	12.074.172,74	
Nettoinventarwert pro Aktie					
B - Thesaurierend	USD	316,33	296,51	344,86	
BH - Thesaurierend	EUR	126,91	122,14	144,88	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	USD	22.622,174	28.008,997	193,340	5.580,163
BH - Thesaurierend	EUR	2.870,170	3.341,514	0,000	471,344

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	8.708.292,86
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	499.093,53
Bankzinsen	15.067,61
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	1.962,31
	516.123,45
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	100.681,80
Depotbank- und Depotgebühr	4.823,35
Zentralverwaltungsvergütung	5.872,84
Erstattete oder erlassene Kosten	-24.528,65
Druck- und Veröffentlichungskosten	3.289,94
Zinsen und Bankspesen	23,78
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a. *	23.197,68
"Taxe d'abonnement"	4.164,45
	117.525,19
Nettoerträge (-verluste)	398.598,26
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-766.557,38
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	11.008,81
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	5.309,99
	-750.238,58
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-351.640,32
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	943.686,82
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	1.728,35
	945.415,17
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	593.774,85
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	61.905,62
Rücknahmen	-1.822.887,35
	-1.760.981,73
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	7.541.085,98

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Jährliche Aufsicht durch die CSSF und sonstige Berichtskosten gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen.

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	79,22
Kanada	7,00
Niederlande	2,89
Luxemburg	2,35
Jersey	0,46
Malta	0,15
Total	92,08

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	31,52
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	5,97
Maschinenbau und Industrieanlagen	5,24
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	4,95
Baustoffe und Bauindustrie	4,72
Petroleum	3,79
Diverse Dienstleistungen	3,48
Nichteisenmetalle	3,01
Energie- und Wasserversorgung	2,89
Verkehr und Transport	2,58
Elektronik und Halbleiter	2,30
Einzelhandel und Warenhäuser	2,13
Elektrische Geräte und Komponenten	1,88
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,81
Immobilien	1,70
Fahrzeuge	1,66
Umweltdienstleistungen und Recycling	1,58
Chemie	1,52
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	1,41
Verpackungsindustrie	1,35
Banken und andere Kreditinstitute	1,33
Telekommunikation	1,11
Verschiedene Konsumgüter	0,97
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	0,88
Versicherungsgesellschaften	0,80
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,66
Computerhardware und Netzwerk	0,61
Gesundheits- und Sozialdienste	0,22
Total	92,08

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD ABC SUPPLY CO INC 144A 4%/19-150128	95.000	85.500,95	1,13
USD ADAMS HOMES INC 144A 7.5%/20-150225	17.000	16.682,89	0,22
USD ADIENT GLOBAL HOLDINGS 144A 7%/23-150428	35.000	34.653,85	0,46
USD ADVANCED DRAINAGE 6.375%/22-150630	100.000	95.030,00	1,26
USD ALLIANT HOLD / CO-ISSUER 6.75%/23-150428	50.000	47.615,50	0,63
USD ALLIED UNIVERSAL 144A 9.75%/19-150727	18.000	15.710,58	0,21
USD AMN HEALTHCARE INC 144A 4%/20-150429	35.000	29.177,75	0,39
USD AMN HEALTHCARE INC 144A 4.625%/19-011027	25.000	22.447,50	0,30
USD ARCO SA INC 144A 4.375%/21-150429	50.000	43.780,50	0,58
USD ARMOR HOLDCO INC 144A 8.5%/21-151129	100.000	87.511,00	1,16
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 4.75%/20-01.03.2023	35.000	29.770,65	0,39
USD ASGN INCORPORATED 144A 4.625%/19-150528	24.000	21.373,68	0,28
USD ATKORE INC 144A 4.25%/21-010631	100.000	82.781,00	1,10
USD AUSTIN BIDCO INC 144A 7.125%/20-151228	140.000	111.750,80	1,48
USD AUTOMATION TOOLING 144A 4.125%/20-151228	105.000	90.154,50	1,20
USD AVIENT CORP 144A 7.125%/22-010830	35.000	33.839,40	0,45
USD BALL CORP 6.875%/22-150328	50.000	49.987,50	0,66
USD BLACK KNIGHT INFOSERV 144A 3.625%/010928	50.000	44.647,50	0,59
USD BOMBARDIER INC 144A 7.5%/23-010229	25.000	23.174,25	0,31
USD BOOZ ALLEN HAMILTON 144A 3.875%/010928	35.000	31.278,10	0,41
USD BOYNE USA INC 144A 4.75%/21-150529	100.000	87.462,00	1,16
USD BUILDERS FIRST 144A 4.25%/21-010232	25.000	19.914,75	0,26
USD BUILDERS FIRSTSOURCE 6.375%/22-150632	40.000	36.705,60	0,49
USD CARGO AIRCRAFT MGMT 144A 4.75%/010228	80.000	70.647,20	0,94
USD CD ESCROW 144A 5.75%/22-010430	40.000	35.845,60	0,48
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS 4.5%/20-011029	80.000	71.650,40	0,95
USD CHURCHILL DOWNS INC -144A- 4.75%/17-15.01.2028	17.000	15.320,23	0,20
USD CIMITAS RESOURCES 8.375%/23-010728	25.000	25.209,75	0,33
USD CIMITAS RESOURCES 8.75%/23-010731	25.000	25.262,75	0,34
USD CLEAN HARBORS INC 144A 5.375%/23-010231	25.000	23.812,00	0,32
USD CNX MIDSTREAM PART LP 4.75%/21-150430	40.000	33.008,40	0,44
USD CNX RESOURCES 144A 7.375%/22-150131	25.000	24.037,25	0,32
USD COMPASS GROUP DIVERSIFIE 144A 5%/150132	50.000	39.390,50	0,52
USD COMPASS GROUP DIVERSIFIE 5.25%/21-150429	75.000	64.208,25	0,85
USD CORELOGIC INC 144A 4.5%/21-010528	125.000	99.232,50	1,32
USD CSC HOLDINGS LLC 144A 4.5%/21-151131	200.000	132.308,00	1,75
USD DORNOCH DEBT MER144A 6.625%/21-151029	65.000	51.217,40	0,68
USD ECO MATERIAL 144A 7.875%/22-310127	50.000	47.575,50	0,63
USD ELASTIC NV 144A 4.125%/21-150729	70.000	59.019,80	0,78
USD ENDURE DIGITAL INC 144A 6%/21-150229	100.000	66.113,00	0,88
USD ENTEGRIS ESCROW 4.75%/22-150429	75.000	67.455,00	0,89
USD ERO COPPER CORP 144A 6.5%/22-150230	75.000	64.036,50	0,85
USD FOUNDATION BUILDING M 144A 6%/21-010329	45.000	37.215,90	0,49
USD GENESIS ENERGY LP/FIN 6.25%/17-150526	45.000	42.959,70	0,57
USD GENESIS ENERGY LP/FIN 6.5%/17-011025	25.000	24.520,50	0,33
USD GLOBAL NET LEASE/GLOBAL 3.75%/20-151227	55.000	41.773,60	0,55
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC 144A 4%/20-150828	100.000	86.432,00	1,15
USD GYP HOLDINGS III 144A 4.625%/21-010529	85.000	69.933,75	0,93
USD H&E EQUIPMENT SERVICES 3.875%/20-151228	70.000	59.444,00	0,79
USD H.B. FULLER CO 4.25%/20-15.10.2028	65.000	56.416,10	0,75
USD HARSCO CORP 144A 5.75%/19-310727	100.000	84.973,00	1,13
USD HEALTHEQUITY INC 144A 4.5%/21-011029	25.000	21.473,50	0,28
USD HESS MIDSTR PART 144A 5.125%/19-150628	50.000	46.426,50	0,62
USD HESS MIDSTREAM 144A 5.5%/22-151030	25.000	22.947,75	0,30
USD II-VI INC 144A 5%/21-151229	50.000	42.512,00	0,56
USD IMOLA MERGER CORP 144A 4.75%/21-150529	65.000	56.807,40	0,75
USD INTL FC STONE INC 144A 6.625%/20-150625	100.000	100.599,00	1,33
USD JACOBS INC 144A 6.75%/22-150229	42.000	35.910,00	0,48
USD JONES DESLAURIERS 10.5%/22-151230	50.000	50.068,00	0,66
USD KAISER ALUMINIUM CORP 144A 4.5%/21-010631	40.000	29.587,60	0,39
USD KBR INC 144A 4.75%/20-300928	35.000	30.864,75	0,41
USD KINETIK HOLDINGS LP 144A 5.875%/22-15063	50.000	46.514,50	0,62
USD LCM INVESTMENTS HOLDINGS 4.875%/010529	35.000	29.465,10	0,39
USD LEVEL 3 FINANCING 144A 3.75%/21-150729	40.000	20.458,80	0,27
USD LITHIA MOTORS INC 144A 3.875%/21-010629	25.000	20.777,75	0,28
USD LVL3 FINANCING INC 144A 3.625%/20-150129	25.000	12.859,00	0,17
USD MAJORDRIVE HLDINGS IV L 6.375%/21-010629	65.000	50.452,35	0,67
USD MASONITE INTERNAT C 144A 5.375%/010228	100.000	92.271,00	1,22
USD MASTEC INC 144A 4.5%/20-150828	16.000	14.068,64	0,19
USD MATTEL INC 144A 3.75%/21-010426	15.000	13.902,30	0,18
USD MATTEL INC 144A 3.75%/21-010429	25.000	21.408,75	0,28
USD MAUSER PACKAGING SOLUT 7.875%/23-150826	30.000	28.137,30	0,37
USD MEDNAX INC 144A 5.375%/22-150230	50.000	43.202,00	0,57
USD MINERVA 144A 6.5%/22-150230	75.000	61.188,75	0,81
USD MIWD HLDCO II/MIWD 5.5%/22-010230	63.000	50.045,31	0,66
USD MSCI INC 144A 4%/19-151129	75.000	64.618,50	0,86
USD MURPHY OIL USA INC 144A 3.75%/21-150231	45.000	36.347,40	0,48
USD NFP CORP 144A 4.875%/21-150828	75.000	66.033,00	0,88
USD NFP CORP -144A- 6.875%/20-15.08.2028	50.000	42.771,00	0,57
USD NFP CORP 144A 7.5%/22-011030	50.000	47.479,00	0,63
USD NORTHERN OIL GAS 144A 8.125%/21-010328	50.000	49.394,00	0,65
USD NOVELIS CORP 144A 3.25%/21-151126	10.000	8.920,20	0,12
USD NOVELIS CORP 144A 3.875%/21-150831	40.000	31.298,80	0,42
USD ON SEMICONDUCTOR CORP 144A 3.875%/010928	50.000	42.974,00	0,57
USD OPEN TEXT HOLD 144A 3.875%/21-011229	45.000	36.943,65	0,49
USD OPEN TEXT HOLD 144A 4.125%/21-011231	20.000	15.767,60	0,21
USD OPTION CARE 144A 4.375%/21-311029	50.000	41.998,00	0,56
USD OWENS-BROCKWAY 7.25%/23-150531	50.000	45.819,50	0,61

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

Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettvermö- gens
USD PANTHER BF AGGREGATOR 2 144A 8.5%/150527	132.000	130.194,24	1,73
USD PAPA JOHN'S INTERNATION 3.875%/21-150929	60.000	49.735,20	0,66
USD PARK RIVER HOLDINGS INC 6.75%/21-010829	25.000	19.059,25	0,25
USD PENSKE AUTOMOTIVE GROUP SUB 3.75%/21- 150	50.000	41.362,50	0,55
USD PIKE CORP -144A- 5.5%/20-01.09.2028	60.000	51.368,40	0,68
USD PMHC III INC 144A 9%/22-150230	115.000	92.320,85	1,22
USD POLAR US BORROWER LLC 6.75%/21-150526	75.000	35.558,25	0,47
USD POLYONE CORP -144A- 5.75%/20-15.05.2025	25.000	24.505,25	0,32
USD PRESIDIO HOLDING INC 144A 3.25%/010228	60.000	56.929,20	0,75
USD PRESTIGE BRANDS INC 144A 3.75%/21-010431	25.000	19.929,25	0,26
USD REGAL REXNORD CORP 144A 6.3%/23-150230	10.000	9.443,30	0,13
USD REGAL REXNORD CORP 144A 6.4%/23-150433	10.000	9.195,20	0,12
USD ROCKIES EXPRESS PIPELI 144A 4.95%/150729	50.000	44.241,00	0,59
USD ROCKIES EXPRESS PIPELIN 144A 4.8%/150530	60.000	50.364,00	0,67
USD RYAN SPECIALTY GROUP 144A 4.375%/22-0102	70.000	60.372,90	0,80
USD SEALED AIR CORP 144A 6.125%/23-010228	25.000	23.808,00	0,32
USD SEAWORLD PARKS 144A 5.25%/21-150829	200.000	174.348,00	2,31
USD SHIFT4 PAYMENTS LLC/FIN 4.625%/20-011126	89.000	82.284,06	1,09
USD SIRIUS XM RADIO INC 144A 3.875%/21-01093	25.000	18.830,50	0,25
USD SIX FLAGS 7.25%/23-150531	75.000	69.090,75	0,92
USD SONIC AUTOMOTIVE 144A 4.625%/21-151129	65.000	54.204,80	0,72
USD SONIC AUTOMOTIVE INC 4.875%/21-151131	25.000	19.936,00	0,26
USD SPEEDWAY MOT FD 144A 4.875%/19-011127	150.000	134.329,50	1,78
USD STARWOOD PROP 144A 4.375%/22-150127	100.000	86.318,00	1,14
USD SUNCOKE ENERGY 144A 4.875%/21-300629	60.000	50.245,80	0,67
USD SUNOCO LP/FINANCE 7%/23-150928	30.000	29.300,70	0,39
USD SYNAPTICS INC 144A 4%/21-150629	55.000	45.778,15	0,61
USD TALLGRASS NRG PRTRN/FIN 7.5%/20-011025	35.000	34.643,70	0,46
USD TASEKO MINES LTD 144A 7%/21-150226	45.000	41.097,60	0,54
USD TELENET FINANCE LUX NOTE 144A 5.5%/17-01	200.000	177.456,00	2,35
USD TEMPUR SEALY INTL INC 3.875%/21-151031	50.000	37.514,00	0,50
USD T-MOBILE USA INC 2.875%/21-150231	40.000	31.911,60	0,42
USD TMS INTERNATIONAL 144A 6.25%/21-150429	83.000	66.043,10	0,88
USD TOPBUILD CORP 144A 3.625%/21-150329	40.000	33.539,60	0,44
USD TRIDENT TPI HOLDINGS 12.75%/23-311228	50.000	51.366,00	0,68
USD TRIMAS CORP 144A 4.125%/21-150429	100.000	83.949,00	1,11
USD TRINET GROUP INC 144A 3.5%/21-010329	35.000	28.980,35	0,38
USD TWILIO INC 3.625%/21-150329	10.000	8.345,60	0,11
USD TWILIO INC 3.875%/21-150331	60.000	48.025,20	0,64
USD UPC BROADBAND FIN 144A 4.875%/21-150731	200.000	159.040,00	2,11
USD US FOODS INC 144A 4.625%/21-010630	20.000	17.102,80	0,23
USD US FOODS INC 144A 6.875%/23-150928	50.000	49.118,50	0,65
USD VERTIV GROUP 144A 4.125%/21-151128	50.000	43.757,00	0,58
USD VIAMI SOLUTIONS INC 144A 3.75%/21-011029	60.000	47.769,00	0,63
USD VICI PROPERTIES / NOTE -144A- 4.625%/19- 01.12.2029	56.000	48.552,00	0,64
USD VISTAJET MALTA/XO 144A 6.375%/22-010230	17.000	11.395,10	0,15
USD WINNEBAGO INDUSTRIES 144A 6.25%/150728	35.000	32.970,35	0,44
USD WR GRACE HOLDING LLC 7.375%/23-010331	16.000	14.856,96	0,20
USD XPO ESCROW SUB 7.5%/22-151127	50.000	49.967,50	0,66
USD XPO INC 144A 6.25%/23-010628	50.000	48.077,50	0,64
USD XPO INC 144A 7.125%/23-010631	15.000	14.634,45	0,19
USD YUM! BRANDS INC 5.375%/22-010432	20.000	17.994,00	0,24
USD ZI TECH LLC/ZI FIN CORP 3.875%/21-010229	85.000	70.280,55	0,93
USD ZIPRECRUITER INC 144A 5%/22-150130	75.000	58.604,25	0,78
Total Anleihen		6.942.285,84	92,06
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		6.942.285,84	92,06
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
USD HIGH RIDGE 8.875%/17-150325	125.000	1.562,50	0,02
Total Anleihen		1.562,50	0,02
Nicht börsennotierte Wertpapiere		1.562,50	0,02
Total des Wertpapierbestandes		6.943.848,34	92,08
Bareinlagen bei Banken und Brokern		481.746,95	6,39
Andere Nettvermögenswerte		115.490,69	1,53
Teilfondsvermögen		7.541.085,98	100,00

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	40678882	LU1785831311	0,65%	0,92%
B - Thesaurierend	USD	35598131	LU1561148120	0,65%	0,92%
DB - Thesaurierend	USD	35598167	LU1561148716	0,00%	0,22%
EA - Ausschüttend	USD	35598168	LU1561148807	0,20%	0,43%
EB - Thesaurierend	USD	35598172	LU1561149284	0,20%	0,43%
UA - Ausschüttend	USD	35598201	LU1561152825	0,45%	0,72%
UB - Thesaurierend	USD	35598205	LU1561153476	0,45%	0,72%
EBH - Thesaurierend	CHF	35598174	LU1561149524	0,20%	0,50%
EB - Thesaurierend	EUR	35598173	LU1561149441	0,20%	0,51%

Für die Aktienklasse -DB- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	-0,05%	/	-10,17%	-1,53%	7,31%
B - Thesaurierend	USD	-0,06%	/	-10,17%	-1,53%	7,32%
DB - Thesaurierend	USD	0,53%	/	-9,55%	-0,85%	8,10%
EA - Ausschüttend	USD	0,35%	/	-9,73%	-1,05%	7,85%
EB - Thesaurierend	USD	0,35%	/	-9,73%	-1,05%	7,82%
UA - Ausschüttend	USD	0,10%	/	-9,99%	-1,33%	7,53%
UB - Thesaurierend	USD	0,11%	/	-9,99%	-1,33%	7,53%
EBH - Thesaurierend	CHF	-3,19%	/	-12,26%	-2,21%	5,49%
EB - Thesaurierend	EUR	-1,63%	-14,54%	-11,80%	/	/

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	20.12.2022	2,49
EA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	29,97
UA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	2,69

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>			(In USD)
EUR 3.054.000	USD -3.221.276	08.11.2023	7.855,50
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>			
USD 2.445.003	EUR -2.290.000	08.11.2023	23.675,68
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>			
USD 8.250.036	EUR -7.600.000	08.11.2023	214.143,71
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			
EUR 930.000	USD -999.610	08.11.2023	-16.279,65
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			
CHF 377.200	USD -423.166	09.11.2023	-8.305,48
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			
CHF 22.700	USD -25.356	09.11.2023	-389,12
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			
EUR 1.983.300	USD -2.093.655	09.11.2023	3.462,64
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>			
CHF 1.410.300	USD -1.550.463	09.11.2023	643,17
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>			
EUR 1.186.200	USD -1.255.904	24.11.2023	-853,59
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>			
CHF 1.423.200	USD -1.602.714	24.11.2023	-34.946,30
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften

189.006,56

Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		467.118.009,68			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.647.405,58			
Forderungen aus Erträgen		4.387.082,00			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		189.006,56			
		475.341.503,82			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		26,86			
		154.874,34			
		154.901,20			
Nettovermögen		475.186.602,62			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	475.186.602,62	553.902.391,47	622.272.956,75	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	93,58	93,43	109,56	
B - Thesaurierend	USD	104,63	101,76	116,66	
DB - Thesaurierend	USD	1.107,93	1.070,07	1.218,28	
EA - Ausschüttend	USD	940,36	939,12	1.101,41	
EB - Thesaurierend	USD	1.088,97	1.053,97	1.202,32	
UA - Ausschüttend	USD	93,77	93,63	109,80	
UB - Thesaurierend	USD	105,76	102,66	117,45	
EBH - Thesaurierend	CHF	903,33	914,30	1.066,07	
EB - Thesaurierend	EUR	854,59	849,41	987,28	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	83.149,754	63.854,834	37.460,175	18.165,255
B - Thesaurierend	USD	187.314,314	144.989,224	72.722,749	30.397,659
DB - Thesaurierend	USD	117.415,941	130.705,262	36.311,482	49.600,803
EA - Ausschüttend	USD	5.874,508	5.072,315	3.946,214	3.144,021
EB - Thesaurierend	USD	279.947,365	346.473,597	48.934,407	115.460,639
UA - Ausschüttend	USD	715,548	715,548	0,000	0,000
UB - Thesaurierend	USD	3.865,596	3.865,596	173,758	173,758
EBH - Thesaurierend	CHF	3.557,399	11.065,399	1.239,000	8.747,000
EB - Thesaurierend	EUR	3.692,000	15.257,000	814,000	12.379,000

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	553.902.391,47
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	19.307.382,44
Bankzinsen	193.406,98
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	145.764,56
	19.646.553,98
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.510.440,50
Depotbank- und Depotgebühr	306.226,60
Zentralverwaltungsvergütung	77.612,88
Druck- und Veröffentlichungskosten	23.171,77
Zinsen und Bankspesen	538,51
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	149.928,71
"Taxe d'abonnement"	48.569,83
	2.116.488,80
Nettoerträge (-verluste)	17.530.065,18
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-26.990.859,29
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	1.194.634,95
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	1.901.054,79
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-297.460,17
	-24.192.629,72
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-6.662.564,54
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	28.901.400,49
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	-84.919,03
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-404.397,09
	28.412.084,37
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	21.749.519,83
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	111.869.227,43
Rücknahmen	-212.023.416,61
	-100.154.189,18
Ausschüttung	-311.119,50
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	475.186.602,62

Aufstellung des Wertpapierbestandes**Geographische Aufteilung**

Vereinigte Staaten	70,68
Grossbritannien	7,66
Japan	4,50
Frankreich	2,60
Niederlande	2,55
Kanada	2,36
Deutschland	1,61
Schweiz	1,26
Singapur	1,25
Schweden	0,78
Spanien	0,78
Vereinigte Arabische Emirate	0,74
Supranational	0,59
Luxemburg	0,38
Australien	0,36
Indien	0,21
Total	98,30

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	33,76
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	16,61
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	5,54
Telekommunikation	4,51
Computerhardware und Netzwerk	3,98
Länder und Zentralregierungen	3,64
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	3,55
Grafikverlags- und Druckmedien	3,02
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,69
Einzelhandel und Warenhäuser	2,57
Petroleum	2,31
Gesundheits- und Sozialdienste	1,95
Energie- und Wasserversorgung	1,76
Elektronik und Halbleiter	1,53
Immobilien	1,47
Chemie	1,37
Tabak und alkoholische Getränke	1,26
Versicherungsgesellschaften	0,81
Edelmetalle und Edelsteine	0,75
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,75
Supranationale Organisationen	0,59
Verpackungsindustrie	0,57
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,54
Verkehr und Transport	0,49
Verschiedene Konsumgüter	0,40
Fahrzeuge	0,39
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,38
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,33
Biotechnologie	0,33
Baustoffe und Bauindustrie	0,27
Elektrische Geräte und Komponenten	0,19
Total	98,30

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD ABBVIE INC 2.95%/20-211126	2.000.000	1.852.420,00	0,39
USD ABBVIE INC 3.2%/20-21.11.2029	3.500.000	3.051.510,00	0,64
USD AFRICA FINANCE CORP 3.125%/20-16.06.2025	3.000.000	2.796.780,00	0,59
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.1%/20-04.06.2030	2.000.000	1.560.280,00	0,33
USD AMAZON.COM INC 3.6%/22-130432	5.000.000	4.344.650,00	0,91
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.375%/22-030524	1.500.000	1.481.340,00	0,31
USD AMERICAN TOWER CORP 2.7%/21-150431	2.000.000	1.548.860,00	0,33
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 2.7%/21-150331	2.000.000	1.586.100,00	0,33
USD AMGEN INC 4.2%/22-010333	2.500.000	2.157.175,00	0,45
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL 4%/17-110927	800.000	742.112,00	0,16
USD ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 3.65%/19-01.02.2026	2.500.000	2.402.725,00	0,51
USD ANTIEM INC 3.65%/17-011227	1.100.000	1.013.771,00	0,21
USD AON CORP 2.8%/20-150530	2.000.000	1.633.680,00	0,34
USD APPLE INC 1.65%/21-090231	3.500.000	2.724.085,00	0,57
USD ARCELORMITTAL SA 4.25%/19-160729	2.000.000	1.602.600,00	0,38
USD ARROW ELECTRONICS INC 3.25%/17-08.09.2024	1.500.000	1.462.785,00	0,31
USD ASHTEAD CAPITAL INC 5.5%/22-110832	1.250.000	1.119.275,00	0,24
USD AT&T INC 1.65%/20-01.02.2028	2.000.000	1.679.440,00	0,35
USD AT&T INC 2.3%/20-010627	2.000.000	1.767.680,00	0,37
USD AT&T INC 2.75%/20-010631	2.000.000	1.574.100,00	0,33
USD AT&T INC 2.95%/19-150726	2.000.000	1.858.340,00	0,39
USD AVNET 4.625%/16-150426	2.000.000	1.920.400,00	0,40
USD BALL CORP 5.25%/15-010725	1.800.000	1.774.134,00	0,37
USD BANCO SANTANDER SA 4.379%/18-120428	1.600.000	1.457.066,00	0,31
USD BANCO SANTANDER SA SUB 2.749%/20-031230	1.800.000	1.317.762,00	0,28
USD BANK OF AMERICA (SUBORDINATED) S. -L- 4%/15-22.01.2025	750.000	730.072,50	0,15
USD BANK OF AMERICA CORP FF FRN/20-190626	4.750.000	4.367.720,00	0,92
USD BANK OF AMERICA CORP FF FRN/22-220733	6.000.000	5.370.240,00	1,13
USD BANK OF AMERICA CORP S. -N- FIX-TO-FRN FRN/20-29.04.2031	4.000.000	3.156.520,00	0,66
USD BANK OF AMERICA FF FRN/22-040225	3.500.000	3.453.765,00	0,73
USD BANK OF AMERICA S N FF FRN/22-040228	2.000.000	1.768.240,00	0,37
USD BANK OF NOVA SCOTIA S I 4.85%/23-010230	2.200.000	2.023.582,00	0,43
USD BANK OF NY MELLON CORP FF FRN/23-010229	3.000.000	2.816.490,00	0,59
USD BANK OF NY MELLON CORP FF FRN/23-010234	700.000	615.713,00	0,13
USD BANK OF NY MELLON S J FF FRN/22-260730	2.000.000	1.845.340,00	0,39
USD BARCLAYS BANK 5.2%/16-120526	1.750.000	1.671.722,50	0,35
USD BARCLAYS BANK PLC 4.836% 17 - 09.05.28	1.000.000	898.900,00	0,19
USD BARCLAYS PLC FF FRN/20-070526	2.000.000	1.896.920,00	0,40
USD BARCLAYS PLC FF FRN/23-090534	3.000.000	2.752.920,00	0,58
EUR BAYER AG FRN/23-250983	2.300.000	2.415.273,54	0,51
USD BAYER US FINANCE II LLC 4.375%/18-151228	2.750.000	2.521.090,00	0,53
USD BECTON DICKINSON AND CO 1.957%/21-110231	2.000.000	1.523.500,00	0,32
USD BECTON DICKINSON AND CO 2.823%/20-20.05.2030	2.000.000	1.648.740,00	0,35
USD BERRY GLOBAL ESCROW 144A 4.875%/150726	1.000.000	955.290,00	0,20
USD BERRY GLOBAL INC 1.57%/21-150126	700.000	632.884,00	0,13
USD BEST BUY CO INC 4.45%/18-011028	1.500.000	1.403.565,00	0,30
USD BNP PARIBAS REG S T I 4.375%/15-280925	4.000.000	3.833.760,00	0,81
USD BNP PARIBAS SUB FF FRN/20-120835	1.200.000	874.812,00	0,18
USD BOSTON PROPERTIES LP 2.9%/19-150330	1.500.000	1.148.940,00	0,24
USD BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	4.650.000	4.428.660,00	0,93
USD BROADCOM INC 3.625%/20-151024	2.000.000	1.956.320,00	0,41
USD BROADCOM INC 4.15%/20-15.11.2030	3.500.000	3.048.535,00	0,64
USD CAMPBELL SOUP CO 2.375%/20-240430	2.000.000	1.585.780,00	0,33
USD CAPITAL ONE FINANCIAL 3.75%/17-090327	1.000.000	903.700,00	0,19
USD CARDINAL HEALTH INC 3.079%/17-150624	2.000.000	1.964.140,00	0,41
USD CARGILL INC S N 144A 2.125%/21-101131	2.500.000	1.900.200,00	0,40
USD CHARLES SCHWAB CORP 1.65%/20-110331	1.500.000	1.071.000,00	0,23
USD CHARTER COMM OPT LLC/CAP 5.05%/19-300329	1.000.000	926.010,00	0,19
USD CITIGROUP 3.7%/16-120126	2.000.000	1.903.720,00	0,40
USD CITIGROUP 4.125%/16-250728	2.000.000	1.796.040,00	0,38
USD CITIGROUP 4.45%/15-29.09.2027	2.500.000	2.311.025,00	0,49
USD CITIGROUP FRN 17-10.01.2028	2.000.000	1.855.180,00	0,39
USD CITIGROUP INC FF FRN/21-031132	2.000.000	1.489.280,00	0,31
USD CITIGROUP INC FF FRN/22-170333	3.000.000	2.439.180,00	0,51
USD CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/19-05.11.2030	2.000.000	1.641.940,00	0,35
USD CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2031	4.000.000	3.538.120,00	0,74
USD CNH INDUSTRIAL CAP LLC 1.875%/20-15.01.2026	2.000.000	1.836.000,00	0,39
USD COCA-COLA EUROPEAN PART 1.5%/21-150127	3.800.000	3.313.410,00	0,70
USD COMCAST CORP 1.5%/20-15.02.2031	2.500.000	1.850.725,00	0,39
USD COMCAST CORP 3.15%/17-150228	2.500.000	2.265.700,00	0,48
USD COMCAST CORP 5.35%/22-151127	2.500.000	2.481.425,00	0,52
USD CONSTELLATION BRANDS 3.5%/17-090527	2.000.000	1.851.900,00	0,39
USD CONSTELLATION BRANDS INC 3.15%/19-010829	2.000.000	1.729.420,00	0,36
USD COOPERATIVE RABOBANK 3.75%/16-210726	2.500.000	2.324.600,00	0,49
USD CVS HEALTH CORP 1.3%/20-210827	3.000.000	2.531.520,00	0,53
USD CVS HEALTH CORP 1.75%/20-21.08.2030	1.500.000	1.134.330,00	0,24
USD CVS HEALTH CORP 5.3%/23-010633	2.500.000	2.307.325,00	0,49
USD DELL INT LLC / EMC CORP 5.3%/21-011029	2.000.000	1.907.620,00	0,40
USD DEUTSCHE BANK NY S D FF FRN/19-261125	3.500.000	3.377.220,00	0,71
USD DEUTSCHE BANK NY S D FF FRN/21-280532	2.500.000	1.865.650,00	0,39
USD DEVON ENERGY CORP 4.5%/21-150130	2.000.000	1.781.500,00	0,37
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS 3.95%/17-20.03.2028	2.000.000	1.806.700,00	0,38
USD DOMINION ENERGY INC S B 4.25%/18-010628	1.500.000	1.399.215,00	0,29
USD DOMINION ENERGY INC S C 3.375%/20-010430	1.500.000	1.261.755,00	0,27

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate 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 DOW CHEMICAL CO/THE 2.1%/20-15.11.2030	1.000.000	776.280,00	0,16	USD NORDBROM INC 2.3%/21-080424	3.000.000	2.952.980,00	0,62
USD ENBRIDGE INC 3.7%/17-150727	2.600.000	2.401.464,00	0,51	USD NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.4%/22-010530	2.500.000	2.097.100,00	0,44
USD ENEL FINANCE N.V. 5%/22-150632	3.000.000	2.641.080,00	0,56	USD NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.875%/22-180626	1.000.000	946.210,00	0,20
USD EXELON CORP 4.05%/20-15.04.2030	2.000.000	1.769.280,00	0,37	USD OMNICOM GROUP INC 2.45%/20-300430	2.800.000	2.221.772,00	0,47
USD EXPRESS SCRIPTS HOLDINGS 3.4%/16-010327	1.050.000	960.592,50	0,20	USD ORACLE CORP 2.3%/21-250328	2.000.000	1.718.740,00	0,36
EUR FIRST ABU DHABI BANK PJS 0.125%/21-16.02.2026	3.700.000	3.533.576,37	0,74	USD ORACLE CORP 2.8%/20-01.04.2027	2.000.000	1.809.980,00	0,38
USD FISERV INC 2.65%/20-010630	2.000.000	1.613.320,00	0,34	USD ORACLE CORP 4.9%/23-060233	2.000.000	1.797.360,00	0,38
USD FISERV INC 3.2%/19-010726	750.000	700.905,00	0,15	USD PACKAGING CORP OF AMERIC 3.4%/17-15.12.2027	1.000.000	914.780,00	0,19
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.7%/21-100826	1.100.000	987.426,00	0,21	USD PARKER-HANNIFIN 3.65%/22-150624	1.500.000	1.478.280,00	0,31
USD FREPORT-MCMORAN INC 5%/19-010927	2.000.000	1.898.420,00	0,40	USD PARKER-HANNIFIN 4.25%/22-150927	1.000.000	948.600,00	0,20
USD GE HEALTHCARE TECH 5.905%/23-221132	1.250.000	1.210.087,50	0,25	USD PEPSCO INC 3.6%/22-180228	2.500.000	2.341.400,00	0,49
USD GE HEALTHCARE TECH INC 5.65%/23-151127	900.000	891.459,00	0,19	USD PEPSCO INC 3.9%/22-180732	2.000.000	1.773.640,00	0,37
USD GENERAL MOTORS FIN 3.95%/17-130424	2.000.000	1.852.540,00	0,39	USD PFIZER INVESTMENT 4.75%/23-190533	3.800.000	3.489.844,00	0,73
USD GENERAL MOTORS FINL CO 3.5%/17-071124	1.000.000	989.450,00	0,21	USD PFIZER INVESTMENT ENTER 4.45%/23-190526	2.500.000	2.440.875,00	0,51
USD GENERAL MOTORS FINL CO 3.85%/23-060430	2.000.000	1.945.680,00	0,41	USD PIONEER NATURAL RESOURCE 1.9%/20-150830	1.500.000	1.173.750,00	0,25
USD GOLDMAN INC FF FRN/21-211032	1.500.000	1.139.740,00	0,24	USD RELIANCE INDUSTRIES (REG. -S-) 4.125%/15-28.01.2025	1.000.000	977.850,00	0,21
USD GOLDMAN SACHS GROUP 3.85%/17-260127	2.000.000	1.863.840,00	0,39	USD ROYAL BANK OF CANADA 3.875%/22-040532	1.000.000	841.770,00	0,18
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.6%/20-070230	3.000.000	2.811.130,00	0,59	USD ROYAL BANK OF CANADA 5%/23-010233	3.000.000	2.713.980,00	0,57
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.8%/20-15.03.2030	2.000.000	1.729.660,00	0,36	USD SANTANDER HOLDINGS 4.5%/15-170725	1.000.000	960.480,00	0,20
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC FF FRN/21-100927	4.500.000	3.914.910,00	0,82	USD SANTANDER HOLDINGS USA 3.45%/20-02.06.2025	2.000.000	1.891.580,00	0,40
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC FIX-TO-FRN FRN/18-01.05.2029	2.500.000	2.282.950,00	0,48	USD SHERWIN-WILLIAMS CO 2.95%/19-15.08.2029	1.500.000	1.279.695,00	0,27
USD GSK CONSUMER 3.375%/22-240327	650.000	599.690,00	0,13	USD SIMON PROPERTY GROUP LP 1.75%/21-0110228	1.000.000	839.930,00	0,18
USD HCA 4.5%/16-150227	1.000.000	946.050,00	0,20	USD SOCIETE GENERALE 3%/20-220130	1.000.000	796.280,00	0,17
USD HCA 5.25%/16-150626	2.500.000	2.441.375,00	0,51	USD SOCIETE GENERALE 4.75%/18-140928	1.000.000	925.520,00	0,20
USD HCA INC 4.125%/19-15.06.2029	1.000.000	887.630,00	0,19	USD SOCIETE GENERALE REG S 4%/12012017	1.000.000	921.070,00	0,19
USD HCA INC 5%/14-150324	1.000.000	995.980,00	0,21	USD SPECTRA ENERGY PARTNERS 3.5%/15-150325	800.000	772.384,00	0,16
USD HESS 4.3%/16-01.04.2027	2.000.000	1.914.900,00	0,40	USD STANDARD CHARTERED REG S 4.05%/16-120426	1.800.000	1.716.759,00	0,36
USD HP ENTERPRISE CO 5.25%/23-010728	4.000.000	3.863.460,00	0,81	USD SUMITOMO MITSUI FINL GR 5.766%/23-130133	2.500.000	2.375.525,00	0,50
USD HP INC 4%/22-150429	3.000.000	2.714.040,00	0,57	USD SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.75%/20-150130	2.500.000	2.032.075,00	0,43
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.95%/20-31.03.2030	800.000	735.880,00	0,15	USD SWEDBANK AB 6.136%/23-120926	3.750.000	3.715.537,50	0,78
USD HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/20-220928	2.500.000	2.101.900,00	0,44	USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.05%/20-31.03.2030	2.400.000	1.898.616,00	0,40
USD HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/23-140827	2.000.000	1.965.420,00	0,41	USD TELEFONICA EMISIONES 4.103%/17-080327	1.000.000	996.790,00	0,20
USD HSBC HOLDINGS PLC FIX-TO-FRN FRN/20-18.04.2026	4.000.000	3.721.480,00	0,78	USD TELEFONICA EUROPE 8.25%/00-15.09.2030	2.000.000	2.176.140,00	0,46
USD HSBC HOLDINGS PLC FRN/18-190629	647.000	589.753,44	0,12	USD TEXAS INSTRUMENTS 4.6%/22-150228	1.000.000	972.120,00	0,20
USD HSBC HOLDINGS PLC FRN/21-240532	3.000.000	2.258.190,00	0,48	USD T-MOBILE USA INC 1.5%/21-150226	1.000.000	907.320,00	0,19
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.875%/20-070425	1.000.000	996.420,00	0,21	USD T-MOBILE USA INC 2.05%/21-150228	3.000.000	2.558.340,00	0,54
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.95%/23-210926	1.900.000	1.887.565,00	0,40	USD T-MOBILE USA INC 2.55%/21-150231	2.000.000	1.559.080,00	0,33
USD IBM CORP 4.15%/22-270727	2.000.000	1.897.060,00	0,40	USD T-MOBILE USA INC 3.875%/21-150430	500.000	435.450,00	0,09
USD IBM CORP 4.4%/22-270732	3.000.000	2.693.700,00	0,57	USD TORONTO-DOMINION BK S C 4.456%/22-080632	2.000.000	1.744.220,00	0,37
USD INEOS QUATTRO FINANCE 2.375%/21-15.01.2026	900.000	860.139,00	0,18	USD TRANSCANADA PIPELINES 2.5%/21-121031	2.000.000	1.509.900,00	0,32
USD ING GROUP NV FRN/22-280326	2.000.000	1.928.580,00	0,41	USD UBS GROUP AG FF 144A FRN/21-110232	2.500.000	1.808.600,00	0,38
USD INTEL CORP 4.875%/23-100228	3.000.000	2.917.830,00	0,61	USD UBS GROUP AG FF 144A FRN/22-050827	2.000.000	1.905.960,00	0,40
USD INTERPUBLIC GROUP COS 4.65%/18-01.10.2028	3.000.000	2.795.040,00	0,59	USD UBS GROUP FUNDING SWITZ 4.253%/17-230328	2.500.000	2.273.375,00	0,48
USD INTERPUBLIC GROUP COS 4.75%/20-300330	1.000.000	912.780,00	0,19	USD UNILEVER CAPITAL CORP 1.75%/21-120831	3.000.000	2.267.640,00	0,48
USD JEFFERIES GROUP LLC 2.75%/20-15.10.2032	2.000.000	1.450.600,00	0,31	USD UNITED PARCEL SERVICE 4.45%/20-010430	2.500.000	2.346.900,00	0,49
USD JOHN DEERE CAP S H 4.85%/22-111029	2.000.000	1.940.040,00	0,41	USD UNITED-HEALTH GROUP 4.2%/22-150532	1.000.000	886.910,00	0,19
USD JOHN DEERE CAPITAL 4.15%/22-150927	2.500.000	2.392.900,00	0,50	USD US TREASURY N/B 3.375%/23-150533	6.000.000	5.306.718,78	1,12
USD JPMORGAN CHASE & CO (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-13.05.2031	2.000.000	1.618.140,00	0,34	USD US TREASURY N/B 3.5%/23-150233	7.000.000	6.267.734,41	1,32
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-040232	3.000.000	2.230.620,00	0,47	USD VERIZON COMMUN 2.355%/22-150332	2.500.000	1.868.300,00	0,39
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-220927	8.000.000	6.970.320,00	1,47	USD VERIZON COMMUNICATIONS 1.75%/20-20.01.2031	3.000.000	2.219.730,00	0,47
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/22-240228	5.000.000	4.503.900,00	0,95	USD VF CORP 2.95%/20-23.04.2030	2.000.000	1.563.420,00	0,33
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/22-250733	3.000.000	2.698.350,00	0,57	USD VIATRIS INC 2.3%/21-220627	1.000.000	857.390,00	0,18
USD KELLOGG CO 2.1%/20-010630	2.500.000	1.948.525,00	0,41	USD VMWARE INC 1.5%/21-150824	1.500.000	1.441.890,00	0,30
USD KIMCO REALTY CORP 1.9%/20-010328	1.500.000	1.247.310,00	0,26	USD VMWARE INC 3.9%/17-210827	4.000.000	3.708.200,00	0,78
USD KINDER MORGAN 4.3%/14-010625	1.800.000	1.752.156,00	0,37	USD WARNERMEDIA HOLDING INC 4.279%/23-150332	2.000.000	1.658.920,00	0,35
USD KINDER MORGAN INC 4.3%/18-010328	2.676.000	2.496.440,40	0,53	USD WELLS FARGO & COMPANY 3%/16-22.04.2026	3.000.000	2.788.080,00	0,59
USD KRAFT HEINZ FOODS 3%/16-010626	4.000.000	3.737.600,00	0,79	USD WELLS FARGO & COMPANY S U FF FRN/22-0203	3.500.000	2.757.860,00	0,58
USD LABORATORY CORP OF AMER 1.55%/21-010626	1.250.000	1.119.762,50	0,24	USD WELLS FARGO 3%/16-231026	1.500.000	1.374.330,00	0,29
USD LABORATORY CORP OF AMER 2.7%/21-010631	1.150.000	907.890,50	0,19	USD WELLS FARGO&COMPANY S Q 4.15%/19-240129	3.000.000	2.725.920,00	0,57
USD LLOYDS BANK 4.65%/16-240326	2.250.000	2.133.000,00	0,45	USD WELLTOWER INC 2.7%/19-15.02.2027	1.500.000	1.355.715,00	0,29
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.375%/18-22032	2.000.000	1.836.300,00	0,39	USD WELLTOWER INC 3.1%/19-15.01.2030	1.000.000	890.970,00	0,17
USD LOWE'S COS INC 3.35%/22-010427	2.000.000	1.852.780,00	0,39	USD WI TREAS. NT/BD S E-2033 4%/23-150833	6.200.000	5.707.390,66	1,20
USD LOWE'S COS INC 3.75%/22-010432	2.000.000	1.677.920,00	0,35	Total Anleihen	461.052.600,68	97,03	
USD MACQUARIE BANK T2 REG S 4.875%/15-100625	1.738.000	1.690.483,08	0,36	Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere	461.052.600,68	97,03	
USD MARATHON OIL CORP 4.4%/17-150727	2.000.000	1.874.920,00	0,39	Nicht börsennotierte Wertpapiere			
USD MARRIOTT INTERNATIONAL S GG 3.5%/20-1510	1.000.000	794.360,00	0,17	Anleihen			
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 2.25%/20-151130	1.000.000	787.210,00	0,17	USD ABN AMRO BANK NV 6.339%/23-180927	1.100.000	1.088.669,00	0,23
USD MCDONALD'S CORP 3.6%/20-010730	2.000.000	1.753.520,00	0,37	USD BPCE S.A. 6.6120%/23-191027	5.000.000	4.976.750,00	1,05
USD MCKESSON CORP 1.3%/21-150826	2.000.000	1.774.860,00	0,37	Total Anleihen	6.065.409,00	1,28	
USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.559%/20-250230	2.500.000	2.009.300,00	0,42	Nicht börsennotierte Wertpapiere	6.065.409,00	1,28	
USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.195%/19-180729	2.000.000	1.705.100,00	0,36	Total des Wertpapierbestandes	467.118.009,68	98,30	
USD MITSUBISHI UFJ FRN/22-120925	2.300.000	2.274.815,00	0,48	Bareinlagen bei Banken und Brokern	3.647.405,58	0,77	
USD MIZUHO FINANCIAL FRN/22-220526	4.000.000	3.778.560,00	0,80	Bankverbindlichkeiten und sonstige	-26,86	0,00	
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP FF FRN/23-270529	2.000.000	1.946.420,00	0,41	Andere Nettovermögenswerte	4.421.214,22	0,93	
USD MONDELEZ INTERNATIONAL 1.875%/20-15.10.2032	3.000.000	2.160.000,00	0,45	Teilfondsvermögen	475.186.602,62	100,00	
USD MORGAN STANLEY (SUBORDINATED) S. -F- 3.95%/15-23.04.2027	2.500.000	2.303.075,00	0,48				
USD MORGAN STANLEY S I FF FRN/19-230130	1.750.000	1.593.707,50	0,34				
USD MORGAN STANLEY S I FF FRN/21-200727	3.000.000	2.634.180,00	0,55				
USD MORGAN STANLEY S I FF FRN/22-200733	2.500.000	2.215.150,00	0,47				
USD MORGAN STANLEY S. -I- FIX-TO-FRN FRN/20-01.04.2031	4.500.000	3.814.380,00	0,80				
USD MOSAIC CO 4.05%/17-151127	2.500.000	2.334.825,00	0,49				
USD MOTOROLA SOLUTIONS INC 2.3%/20-151130	2.500.000	1.913.600,00	0,40				
USD NATWEST GROUP PLC FF FRN/21-140627	1.500.000	1.319.580,00	0,28				
USD NATWEST MARKETS 144A 3.479%/22-220325	1.500.000	1.447.770,00	0,30				
USD NEWMONT GOLDCORP CORP 2.8%/19-011029	2.000.000	1.678.740,00	0,35				
USD NOMURA HOLDINGS 2.329%/22-220127	2.000.000	1.753.680,00	0,37				
USD NOMURA HOLDINGS INC 3.103%/20-16013							

Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	48786752	LU2022004787	1,20%	1,47%
B - Thesaurierend	USD	48786756	LU2022005164	1,20%	1,47%
DA - Ausschüttend	USD	48786763	LU2022005677	0,00%	0,12%
DB - Thesaurierend	USD	48786764	LU2022005750	0,00%	0,12%
IA - Ausschüttend	USD	48765181	LU2022006139	0,60%	0,88%
IB - Thesaurierend	USD	48765189	LU2022006568	0,60%	0,88%
MB - Thesaurierend	USD	48735704	LU2022009406	0,30%	0,48%
UA - Ausschüttend	USD	48767290	LU2022010834	0,70%	0,97%
UB - Thesaurierend	USD	48767312	LU2022011212	0,70%	0,97%
DBH - Thesaurierend	CHF	48786770	LU2022011998	0,00%	0,15%
IBH - Thesaurierend	EUR	48765147	LU2022006642	0,60%	0,95%

Für die Aktienklassen -DA-, -DB- und -DBH- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	-0,42%	/	-8,02%	0,61%	6,29%
B - Thesaurierend	USD	-0,42%	/	-8,02%	0,62%	6,27%
DA - Ausschüttend	USD	0,72%	/	-6,81%	1,92%	7,66%
DB - Thesaurierend	USD	0,72%	/	-6,81%	1,92%	7,66%
IA - Ausschüttend	USD	0,08%	/	-7,47%	1,30%	7,18%
IB - Thesaurierend	USD	0,08%	/	-7,47%	1,30%	7,18%
MB - Thesaurierend	USD	0,40%	4,61%	-7,04%	1,75%	/
UA - Ausschüttend	USD	0,00%	/	-7,56%	1,11%	6,81%
UB - Thesaurierend	USD	0,00%	/	-7,56%	1,11%	6,81%
DBH - Thesaurierend	CHF	-2,72%	-10,50%	-9,31%	/	/
IBH - Thesaurierend	EUR	-1,83%	/	-9,70%	0,37%	4,92%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	06.12.2022	1,13
A - Ausschüttend	USD	07.03.2023	1,12
A - Ausschüttend	USD	06.06.2023	1,03
A - Ausschüttend	USD	05.09.2023	1,09
DA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	14,40
DA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	14,19
DA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	13,19
DA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	14,00
IA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	12,75
IA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	12,51
IA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	11,60
IA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	12,28
UA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	1,25
UA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	1,23
UA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	1,13
UA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	1,21

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					
EUR	1.180.200	USD	-1.245.869	09.11.2023	2.060,51
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	418.933	EUR	-380.000	09.11.2023	17.119,17
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	11.800	USD	-12.486	09.11.2023	-8,58
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
CHF	9.888.500	USD	-10.871.268	09.11.2023	4.509,66
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	96.200	USD	-108.163	09.11.2023	-2.358,71
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.192.000	USD	-1.262.045	24.11.2023	-857,76
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	9.984.700	USD	-11.244.108	24.11.2023	-245.171,67
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-224.707,38

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		143.615.898,90			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		429.968,54			
Forderungen aus Erträgen		2.489.059,49			
		146.534.926,93			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		385.711,55			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		74.008,13			
		224.707,38			
		684.427,06			
Nettovermögen		145.850.499,87			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	145.850.499,87	209.734.412,12	423.411.715,08	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	84,77	83,26	101,78	
B - Thesaurierend	USD	100,46	93,88	109,76	
DA - Ausschüttend	USD	850,47	835,28	1.021,43	
DB - Thesaurierend	USD	1.059,73	976,96	1.127,39	
IA - Ausschüttend	USD	848,81	833,77	1.019,52	
IB - Thesaurierend	USD	1.033,45	959,98	1.115,55	
MB - Thesaurierend	USD	1.046,10	967,96	1.119,36	
UA - Ausschüttend	USD	84,87	83,36	101,92	
UB - Thesaurierend	USD	102,53	95,33	110,89	
DBH - Thesaurierend	CHF	895,04	862,80	1.015,21	
IBH - Thesaurierend	EUR	953,30	910,16	1.077,09	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	105.726,703	193.263,560	8.984,546	96.521,403
B - Thesaurierend	USD	86.453,286	131.965,377	10.038,370	55.550,461
DA - Ausschüttend	USD	12.813,367	15.513,697	1.460,000	4.160,330
DB - Thesaurierend	USD	23.517,559	41.534,178	4.593,970	22.610,589
IA - Ausschüttend	USD	22.615,969	48.818,454	0,000	26.202,485
IB - Thesaurierend	USD	25.212,924	34.966,935	5.438,432	15.192,443
MB - Thesaurierend	USD	12.018,590	28.095,923	0,000	16.077,333
UA - Ausschüttend	USD	30.742,420	36.854,445	2.534,699	8.646,724
UB - Thesaurierend	USD	74.622,089	110.938,434	21.256,373	57.572,718
DBH - Thesaurierend	CHF	22.158,360	13.000,000	9.158,360	0,000
IBH - Thesaurierend	EUR	2.486,481	1.552,728	1.503,753	570,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	209.734.412,12
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	12.285.959,17
Bankzinsen	91.351,90
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	223.848,02
	12.601.159,09
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	907.818,96
Depotbank- und Depotgebühr	113.852,78
Zentralverwaltungsvergütung	91.302,19
Druck- und Veröffentlichungskosten	14.531,37
Zinsen und Bankspesen	3.598,81
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	120.437,81
"Taxe d'abonnement"	53.084,41
	1.304.626,33
Nettoerträge (-verluste)	11.296.532,76
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-13.144.821,81
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-397.242,06
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	-16.233,24
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	1.177.654,46
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-262.429,41
	-12.643.072,06
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.346.539,30
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	19.218.544,05
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-256.905,23
	18.961.638,82
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	17.615.099,52
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	26.582.973,19
Rücknahmen	-104.340.464,15
	-77.757.490,96
Ausschüttung	-3.741.520,81
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	145.850.499,87

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Mexiko	17,18
Peru	10,84
Kolumbien	9,90
Chile	9,64
Luxemburg	8,74
Argentinien	7,38
Niederlande	4,60
Brasilien	4,28
Kaimaninseln	3,81
Vereinigte Staaten	3,70
Österreich	3,30
Panama	3,17
Bermudas	2,94
Spanien	1,99
Irland	1,47
Guatemala	1,44
Kanada	1,33
Grossbritannien	1,01
Britische Jungferninseln	1,00
Dominikanische Republik	0,43
Paraguay	0,31
Total	98,47

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	22,66
Petroleum	17,92
Banken und andere Kreditinstitute	17,67
Telekommunikation	7,97
Energie- und Wasserversorgung	6,13
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	3,75
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	3,26
Länder und Zentralregierungen	2,38
Diverse Dienstleistungen	2,32
Chemie	1,71
Landwirtschaft und Fischerei	1,49
Edelmetalle und Edelsteine	1,38
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	1,32
Baustoffe und Bauindustrie	1,30
Einzelhandel und Warenhäuser	1,28
Nichteisenmetalle	1,01
Verkehr und Transport	0,95
Tabak und alkoholische Getränke	0,89
Anlagefonds	0,86
Immobilien	0,79
Fahrzeuge	0,53
Elektrische Geräte und Komponenten	0,31
Verpackungsindustrie	0,31
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,27
Total	98,47

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD ADECOAGRO SA 6%/17-21.09.2027	500.000	464.360,00	0,32
USD AEROPUERTOS ARG S 2021 144A 8.5%/21-010831	500.000	458.695,00	0,31
USD AEROPUERTOS DOMINICANOS 6.75%/17-300329	250.000	241.035,00	0,17
USD AES PANAMA GENERATION HL 4.375%/20-31.05.2030	3.000.000	2.430.989,80	1,67
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU 5.75%/21-150633	2.500.000	1.709.075,00	1,17
USD ALFA SAB 144A 6.875%/14-25.03.2044	1.000.000	869.540,00	0,62
USD ALPEK SA DE CV 3.25%/21-250231	400.000	304.272,00	0,21
USD ALPEK SA DE CV 4.25%/19-180929	500.000	423.785,00	0,29
USD AMERICA MOVIL 4.375%/12-160742	1.250.000	961.425,00	0,66
USD AMERICA MOVIL 6.125%/10-300340	1.500.000	1.426.065,00	0,98
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.625%/19-220429	1.000.000	891.270,00	0,61
USD ANTOFAGASTA PLC 2.375%/20-14.10.2030	750.000	567.982,50	0,39
USD ALUNA SA 6.5%/20-20.11.2025	1.500.000	1.374.060,00	0,94
USD B3 SA-BRASIL BOLSA BALC 4.125%/21-200931	750.000	1.222.232,50	0,42
USD BANC CREDITO INVERSIONES 3.5%/17-121027	1.250.000	1.134.500,00	0,78
USD BANCO DE BOGOTA SA (SUBORDINATED)	1.000.000	947.080,00	0,65
USD BANCO DE CHILE 2.99%/21-091231	1.500.000	1.192.665,00	0,82
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU 3.25%/21-300931	4.250.000	3.729.757,50	2,56
USD BANCO DO BRASIL REG S FF 6.25%/13-PERPET	3.000.000	2.878.380,00	1,97
USD BANCO GENERAL SA 4.125%/17-07.08.2027	1.000.000	917.040,00	0,63
USD BANCO GENERAL SA SUB FF FRN/21-PERPET	1.000.000	888.080,00	0,61
USD BANCO INBURSA 4.375%/17-11.04.2027	1.500.000	1.384.710,00	0,95
USD BANCO INDUSTRIAL SA SUB FF FRN/21-290131	1.250.000	1.136.412,50	0,78
USD BANCO INT DEL PERU SUB FF FRN/20-080730	1.000.000	925.300,00	0,63
USD BANCO INTERNAC DEL PERU 3.25%/19-04.10.2026	1.300.000	1.198.223,00	0,82
USD BANCO MACRO SA SUB FF FRN/16-041126	1.000.000	805.460,00	0,55
USD BANCO MERCANTIL FF FRN/21-PERPET	1.500.000	1.275.180,00	0,87
USD BANCOLOMBIA SA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-18.12.2029	1.500.000	1.317.600,00	0,90
USD BANCOLOMBIA SA SUB FF FRN/17-181027	1.500.000	1.382.505,00	0,95
USD BBANCO MERCANTIL DE NOR SUB FF FRN/PERFE	1.000.000	972.590,00	0,67
USD BEVA BANCOMER SA 8.45%/23-290638	500.000	477.720,00	0,33
USD BEVA BANCOMER SA TEXAS SUB FF FRN/180133	1.500.000	1.271.415,00	0,87
USD BIMBO BAKERIES USA INC 6.4%/23-150134	300.000	300.381,00	0,21
USD BRASKEM IDESA SAFI 6.99%/21-200232	450.000	265.473,00	0,18
USD BRASKEM IDESA SAFI 7.45%/19-15.11.2029	250.000	158.325,00	0,11
USD BRASKEM NETHERLANDS B.V. 4.5%/19-31.01.2030	1.750.000	1.346.362,50	0,92
USD BRF SA 4.875%/19-24.01.2030	1.000.000	814.450,00	0,56
USD C&W SENIOR FINANCING DAC 6.875%/150927	2.500.000	2.146.250,00	1,47
USD CABLE ONDA SA 4.5%/19-300130	500.000	394.515,00	0,27
USD CAMPOSOL SA 6%/20-030227	1.500.000	890.325,00	0,61
USD CANACOL ENERGY LTD 5.75%/21-241128	750.000	541.102,50	0,37
USD CELULOSA ARAUCO CONSTITU 3.875%/18-02.11.2027	750.000	672.570,00	0,46
USD CELULOSA ARAUCO CONSTITU 4.25%/19-300429	1.000.000	870.750,00	0,60
USD CELULOSA ARAUCO CONSTITU 5.5%/18-02.11.2047	250.000	188.865,00	0,13
USD CEMEX SAB DE CV 3.875%/21-11.07.2031	500.000	406.320,00	0,28
USD CEMEX SAB DE CV 5.45%/19-19.11.2029	500.000	466.325,00	0,32
USD CEMEX SAB DE CV SUB FF FRN/23-PERPET	1.000.000	1.026.660,00	0,70
USD CENCOSUD SA 4.375%/17-17.07.2027	1.000.000	918.140,00	0,63
USD CENCOSUD SA 6.625%/15-120245	1.000.000	952.600,00	0,65
USD CERRO DEL AGUILA SA 4.125%/17-16.08.2027	500.000	453.475,00	0,31
USD CIA DE MINAS BUENAVENTUR 5.5%/21-230726	800.000	699.168,00	0,48
USD CNIL AMR BOTTLING 5.25%/22-270429	1.250.000	1.106.662,50	0,76
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75%/20-22.01.2030	1.750.000	1.469.650,00	1,01
USD COLBUN SA 3.15%/20-06.03.2030	2.000.000	1.639.460,00	1,12
USD COSAN LUXEMBOURG 7.5%/23-270630	1.000.000	976.290,00	0,67
USD CSN ISLANDS XI CORP 6.75%/20-28.01.2028	750.000	686.957,50	0,47
USD CSN RESOURCES SA 5.875%/22-080432	500.000	395.585,00	0,27
USD CT TRUST 5.125%/22-030232	1.250.000	962.587,50	0,66
USD DIGICEL GROUP 0.5 LTD 144A 8%/20-010425	522.840	82.126,63	0,06
USD DIGICEL GROUP 0.5 LTD SUB CV 144A 7%/20-010425	1.781.530	141.629,59	0,10
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD 144A 13%/20-311	1.606.532	1.127.801,53	0,77
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD 144A 8.75%/20-2	800.000	732.544,00	0,50
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD 8.75%/19-250524	700.000	630.490,00	0,43
USD DIGICEL REG S 6.75%/15-010323	3.500.000	121.765,00	0,08
USD ECOPETROL 5.375%/15-26.06.2026	1.000.000	957.990,00	0,66
USD ECOPETROL 5.875%/14-28.05.2045	2.000.000	1.304.560,00	0,89
USD ECOPETROL SA 4.625%/21-021131	3.750.000	2.818.387,50	1,93
USD ECOPETROL SA 6.875%/20-29.04.2030	1.000.000	901.010,00	0,62
USD ECOPETROL SA 8.625%/23-190129	750.000	749.805,00	0,51
USD ECOPETROL SA 8.875%/23-130133	3.750.000	3.610.200,00	2,48
USD EMBRAER NETHERLANDS FINA 7%/23-280730	1.250.000	1.220.700,00	0,84
USD EMPRESA GEN ELEC 5.625%/21-081128	450.000	390.217,50	0,27
USD ENEL CHILE SA 4.875%/18-12.06.2028	1.750.000	1.632.452,50	1,12
USD ENERGUATE TRUST 5.875%/17-030527	500.000	450.975,00	0,31
USD ENFRAGEN ENERGIA SUR SA 5.375%/20-30.12.2030	750.000	505.875,00	0,35
USD ENTEL CHILE SA 3.05%/21-140932	1.750.000	1.257.497,50	0,86
USD ERO COPPER CORP 6.5%/22-150230	500.000	426.910,00	0,29
USD FIDEICOM F/1401 REG S 6.95%/14-300144	1.500.000	1.150.650,00	0,79
USD FIRST QUANTUM MINERALS L 6.875%/18-01.03.2026	250.000	220.067,50	0,15

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD FOMENTO ECONOMICO MEX 3.5%/20-16.01.2029	2.000.000	1.298.620,00	0,89
USD FRESNILLO PLC 4.25%/20-02.10.2050	650.000	431.366,00	0,30
USD FRONTERA ENERGY CORP 7.875%/21-210628	1.000.000	757.870,00	0,52
USD FS LUXEMBOURG SARL 10%/20-15.12.2025	250.000	255.862,50	0,18
USD GAS NATURAL LICUADO QUINTERO (REG. -S-) 4.634%/14-31.07.2029	1.000.000	670.572,92	0,46
USD GCC SAB DE CV 3.614%/22-200432	1.000.000	785.280,00	0,54
USD GEOPARK LTD 5.5%/20-17.01.2027	1.250.000	1.053.737,50	0,72
USD GOL FINANCE SA 7%/17-310125	550.000	269.423,00	0,18
USD GRAN TIERRA ENERGY INC 9.5%/23-151029	925.000	796.249,88	0,55
USD GRUPO BIMBO REG S 4.875%/14-270644	1.500.000	1.199.835,00	0,82
USD GRUPO KLUO SAB DE CV 5.75%/17-070727	400.000	337.735,00	0,23
USD GRUPO TELEvisa 6.625%/10-15.01.2040	1.000.000	943.300,00	0,65
USD GTL TRADE FINANCE 7.25%/14-160444	350.000	346.594,50	0,24
USD GUSAP III LP 4.25%/19-21.01.2030	250.000	221.297,50	0,15
USD HIDROVIAS INT FIN SARL 4.95%/21-08.02.2031	750.000	579.405,00	0,40
USD HUNT OIL CO OF PERU 8.55%/23-180933	750.000	752.220,00	0,52
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB D 4.15%/19-12.09.2029	1.000.000	877.200,00	0,60
USD INFRAESTRUCTURA ENERGETI 4.875%/140148	250.000	175.070,00	0,12
USD INKIA ENERGY LTD 5.875%/17-091127	417.000	393.293,55	0,27
USD INRETAIL CONSUMER 3.25%/21-220328	750.000	631.507,50	0,43
USD INTL AIRPORT FINANCE SA 12%/19-150333	750.000	689.922,11	0,47
USD INVERSIONES CMPC (REG. -S-) 4.375%/17-04.04.2027	1.500.000	1.405.755,00	0,96
USD INVERSIONES CMPC SA 6.125%/23-230633	250.000	234.400,00	0,16
USD IOCHPE-MAX/MAX WHEELS MX 5%/21-070528	250.000	216.595,00	0,15
USD ITAU UNIBANCO REG S FF 6.125%/17-PERPET	2.000.000	1.939.280,00	1,33
USD KALLPA GENERACION (REG.-S-) 4.875%/16-24.05.2026	1.000.000	955.030,00	0,65
USD KENBOURNE INVEST SA 4.7%/21-22.01.2028	1.000.000	560.330,00	0,38
USD KENBOURNE INVEST SA 6.875%/19-261124	932.000	704.470,84	0,48
USD KLABIN AUSTRIA GMBH 3.2%/21-120131	1.500.000	1.150.035,00	0,79
USD KLABIN AUSTRIA GMBH 7%/19-030449	250.000	229.300,00	0,16
USD LIBERTY COSTA RICA SR 10.875%/23-150131	750.000	731.760,00	0,50
USD LIMA METRO LINE 2 FIN LT 5.875%/15-05.07.2034	2.000.000	845.752,31	0,58
USD MARB BOND CO PLC 3.95%/21-29.01.2031	650.000	479.199,50	0,33
USD MC BRAZIL DWINSTRM 7.25%/21-300631	950.000	653.113,61	0,45
USD MEXICHEM (REG. -S-) 5.875%/14-17.09.2044	1.000.000	784.140,00	0,54
USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.25%/19-250329	3.000.000	2.352.051,00	1,61
USD MINERVA LUXEMBOURG SA 4.375%/21-180331	1.500.000	1.161.630,00	0,80
USD MINSUR SA 4.5%/21-281031	1.250.000	1.018.087,50	0,70
USD MX REMIT FUND FIDUC EST 4.875%/21-15.01.2028	750.000	554.932,50	0,38
USD NEMAK SAB DE CV 3.625%/21-280631	1.250.000	1.175.687,50	0,81
USD NEXA RESOURCES S.A. 6.5%/20-18.01.2028	505.000	445.202,95	0,31
USD OLEODUCTO CENTRAL SA 4%/20-140727	500.000	453.275,00	0,31
USD ORAZUL ENERGY EGENOR 5.625%/17-280427	1.000.000	893.590,00	0,61
USD ORBIA ADVANCE CORP SAB 1.875%/21-110526	1.500.000	1.396.845,00	0,96
USD PAMPA ENERGIA REG S 7.5%/17-240127	1.250.000	961.925,00	0,66
USD PERU LNG SRL 5.375%/18-220330	1.000.000	932.180,00	0,64
USD PETROBRAS GLOBAL 6.5%/23-030733	750.000	690.487,50	0,47
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5.093%/20-150130	750.000	704.857,50	0,48
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 6.85%/15-05.06.2115	750.000	633.270,00	0,43
USD PETROBRAS INTL FIN 6.875%/09-200140	1.000.000	941.210,00	0,65
USD PETRORIO LUXEMBOURG 6.125%/21-090626	250.000	238.370,00	0,16
EUR REPUBLIC OF ARGENTINA 0.5%/20-09.07.2029	1.022	264,52	0,00
EUR REPUBLIC OF ARGENTINA 1%/20-09.07.2029	52.298	14.031,55	0,01
EUR REPUBLIC OF ARGENTINA STEP-UP/20-090741	500.000	115.223,57	0,08
USD REPUBLIC OF ARGENTINA STEP-UP/20-090746	1.697.500	421.455,30	0,29
USD RUMO LUXEMBOURG SARL 4.2%/21-180132	1.500.000	1.160.160,00	0,80
USD SABLE INTL FINANCE LTD 5.75%/19-070927	800.000	726.256,00	0,50
USD SIERRACOL ENRGY ANDINA 6%/21-150628	1.500.000	1.157.685,00	0,79
USD SIMPAR EUROPE SA 5.2%/21-26.01.2031	500.000	390.570,00	0,27
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75%/20-15.01.2031	1.000.000	810.520,00	0,56
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 6%/19-15.01.2029	2.500.000	2.406.275,00	1,65
USD TELECOM ARGENTINA SA 8%/19-180726	250.000	235.655,00	0,16
USD TELECOM ARGENTINA SA 8.5%/20-06.08.2025	500.000	327.110,75	0,22
USD TELEFONICA CHILE 3.537%/21-181131	750.000	516.997,50	0,35
USD TELFON CELUAR DEL PARAGU 5.875%/19-15.04.2027	500.000	453.510,00	0,31
USD TERMOCANDELARIA POWER 7.875%/19-30.01.2029	1.750.000	1.277.451,88	0,88
USD TOTAL PLAY TELECOM 6.375%/21-200928	750.000	360.675,00	0,25
USD TOTAL PLAY TELECOM 7.5%/20-12.11.2025	500.000	363.725,00	0,25
USD TRANS PERU (REG. -S-) 4.25%/13-30.04.2028	1.350.000	1.277.113,50	0,88
USD TRANSPORT DE GAS DEL SUR 6.75%/18-02.05.2025	1.000.000	922.130,00	0,63
USD TRUST F/1401 4.869%/19-15.01.2030	1.500.000	1.252.350,00	0,86
USD TUPY OVERSEAS SA 4.5%/21-16.02.2031	500.000	391.275,00	0,27
USD VALE OVERSEAS LIMITED 3.75%/20-08.07.2030	1.000.000	842.070,00	0,58
USD VOLCAN CIA MINERA SAA-CM 4.375%/21-11.02.2026	1.000.000	484.380,00	0,33
USD VTR COMUNICACIONES SPA 5.125%/20-150128	1.750.000	774.777,50	0,53
USD VTR COMUNICACIONES SPA 6.375%/20-150728	1.350.000	241.744,50	0,17
USD YPF (REG. -S-) 8.5%/15-28.07.2025	1.750.000	1.590.155,00	1,09
USD YPF ENERGIA ELECTRICA SA 10%/19-25.07.2026	1.000.000	914.380,00	0,63
USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 6.95%/17-21.07.2027	2.000.000	1.512.720,00	1,04
USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 7%/17-15.12.2047	2.000.000	1.287.760,00	0,88
USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 8.5%/19-270629	500.000	385.615,00	0,26
USD YPF SOCIEDAD ANONIMA STEP-UP/21-120226	500.000	374.976,92	0,26
Total Anleihen		140.241.731,71	96,15

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		140.241.731,71	96,15
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
USD AEGEA FINANCE S.A R.L. 9%/23-200131	450.000	448.488,00	0,31
Total Anleihen		448.488,00	0,31
Nicht börsennotierte Wertpapiere		448.488,00	0,31
Geldmarktinstrumente			
USD TREASURY BILL 0%/23-180424	3.000.000	2.925.679,19	2,01
Total Geldmarktinstrumente		2.925.679,19	2,01
Total des Wertpapierbestandes		143.615.898,90	98,47
Bareinlagen bei Banken und Brokern		429.968,54	0,29
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-385.711,55	-0,26
Andere Nettovermögenswerte		2.190.343,98	1,50
Teilfondsvermögen		145.850.499,87	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
A - Ausschüttend	USD	59098538	LU2279741255	1,08%	1,50%
DA - Ausschüttend	USD	59098539	LU2279741412	0,00%	0,12%
IA - Ausschüttend	USD	59098540	LU2279741685	0,58%	/
IBH25 - Thesaurierend	USD	59100871	LU2279743467	0,30%	0,71%
UA - Ausschüttend	USD	59098547	LU2279742576	0,58%	1,15%
A - Ausschüttend	CHF	59100935	LU2279744358	1,08%	1,50%
AH - Ausschüttend	CHF	59100829	LU2279745918	1,08%	1,56%
DAH - Ausschüttend	CHF	59100937	LU2279746130	0,00%	0,15%
UA - Ausschüttend	CHF	59100818	LU2279745751	0,58%	1,01%
UAH - Ausschüttend	CHF	59100909	LU2279747450	0,58%	1,11%
EBH - Thesaurierend	CHF	59100883	LU2279746999	0,42%	0,87%
EBH - Thesaurierend	EUR	110589165	LU2320773794	0,42%	0,86%

Für die Aktienklassen -DA- und -DAH- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund -IA- wurde am 01.02.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022
A - Ausschüttend	USD	-1,50%	-22,28%	-19,70%
DA - Ausschüttend	USD	-0,42%	-20,36%	-18,63%
IA - Ausschüttend	USD	/	/	-19,29%
IBH25 - Thesaurierend	USD	0,40%	-17,26%	-17,39%
UA - Ausschüttend	USD	-1,08%	-21,24%	-19,29%
A - Ausschüttend	CHF	-3,11%	-23,58%	-18,45%
AH - Ausschüttend	CHF	-3,58%	-24,23%	-20,20%
DAH - Ausschüttend	CHF	-2,49%	-21,50%	-19,10%
UA - Ausschüttend	CHF	-2,70%	-22,56%	-18,05%
UAH - Ausschüttend	CHF	-3,17%	-23,23%	-19,79%
EBH - Thesaurierend	CHF	-3,01%	-23,59%	-19,66%
EBH - Thesaurierend	EUR	-1,51%	-22,53%	-19,35%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
DA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	7,44
IA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	0,92
UA - Ausschüttend	USD	20.12.2022	0,08
DAH - Ausschüttend	CHF	20.12.2022	14,18
UA - Ausschüttend	CHF	20.12.2022	0,08

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					
USD	10.000.000	CHF	-8.912.510	08.12.2023	166.040,43
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.000.000	CHF	-1.766.580	08.12.2023	50.703,33
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	6.040	USD	-6.500	08.12.2023	-104,64
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	496.118	GBP	-450.000	08.12.2023	1.171,93
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	17.110.080	EUR	-18.000.000	08.12.2023	-179.393,30
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	962.627	JPY	-140.000.000	08.12.2023	32.370,42
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	70.664.480	USD	-80.000.000	08.12.2023	-2.035.031,24
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					<i>(In USD)</i>
EUR	1.500.000	CHF	-1.417.358	08.12.2023	24.233,70
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	307	JPY	-48.000	08.12.2023	5,98
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.920.480	HKD	-17.000.000	08.12.2023	-55.199,52
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	3.959.415	EUR	-3.680.000	08.12.2023	63.121,76
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	511.573	HKD	-4.000.000	08.12.2023	13,93
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	3.949.718	JPY	-650.000.000	08.12.2023	39.397,02
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-1.892.670,20

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		137.347.722,61			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.660.179,52			
Forderungen aus Erträgen		444.951,37			
		141.452.853,50			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		37.113,19			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		1.892.670,20			
		1.929.783,39			
Nettovermögen		139.523.070,11			
Teilfondsentwicklung		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	139.523.070,11	159.841.579,59	225.569.744,80	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	392,39	389,45	511,18	
DA - Ausschüttend	USD	787,63	778,30	1.010,77	
IA - Ausschüttend	USD	/	1.350,15	1.763,27	
IBH25 - Thesaurierend	USD	827,37	818,66	1.022,73	
UA - Ausschüttend	USD	122,94	121,48	158,65	
A - Ausschüttend	CHF	233,87	255,25	305,89	
AH - Ausschüttend	CHF	109,35	113,86	146,16	
DAH - Ausschüttend	CHF	1.421,61	1.473,37	1.875,57	
UA - Ausschüttend	CHF	118,02	128,25	152,92	
UAH - Ausschüttend	CHF	106,97	110,81	141,53	
EBH - Thesaurierend	CHF	771,73	797,86	1.017,60	
EBH - Thesaurierend	EUR	774,68	788,09	1.001,88	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	5.269,112	7.013,117	0,000	1.744,005
DA - Ausschüttend	USD	18.907,192	7.500,221	13.972,773	2.565,802
IA - Ausschüttend	USD	0,000	7.969,087	0,000	7.969,087
IBH25 - Thesaurierend	USD	25.000,000	25.000,000	0,000	0,000
UA - Ausschüttend	USD	194,000	5.494,000	0,000	5.300,000
A - Ausschüttend	CHF	33.600,829	43.732,897	1.116,495	11.248,563
AH - Ausschüttend	CHF	316,000	266,000	50,000	0,000
DAH - Ausschüttend	CHF	56.496,075	66.515,953	5.288,741	15.308,619
UA - Ausschüttend	CHF	23.396,573	35.932,005	1.333,129	13.868,561
UAH - Ausschüttend	CHF	215,000	765,000	250,000	800,000
EBH - Thesaurierend	CHF	2.198,111	6.985,688	113,993	4.901,570
EBH - Thesaurierend	EUR	10,000	10,000	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
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	159.841.579,59
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.568.184,95
Dividenden (Netto)	323.759,61
Bankzinsen	180.482,76
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	86.079,98
	2.158.507,30
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	370.350,89
Depotbank- und Depotgebühr	96.115,15
Zentralverwaltungsvergütung	32.685,99
Druck- und Veröffentlichungskosten	14.751,05
Zinsen und Bankspesen	24.238,35
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.*	107.243,51
"Taxe d'abonnement"	20.558,88
	665.943,82
Nettoerträge (-verluste)	1.492.563,48
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-8.224.398,65
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	5.754.835,19
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-2.275.856,15
	-4.745.419,61
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-3.252.856,13
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	10.810.839,21
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	2.153.884,57
	12.964.723,78
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	9.711.867,65
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	20.692.452,22
Rücknahmen	-49.717.611,12
	-29.025.158,90
Ausschüttung	-1.005.218,23
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	139.523.070,11

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Sonstige Berichtskosten gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen. Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	55,82
Kaimaninseln	5,28
Frankreich	5,14
Japan	4,67
Niederlande	3,44
Italien	3,11
Kanada	2,57
Südkorea	2,09
Britische Jungferninseln	1,95
Liberia	1,82
Deutschland	1,81
Spanien	1,57
Luxemburg	1,56
Bermudas	1,07
Hongkong	0,69
Grossbritannien	0,66
Dänemark	0,55
Indien	0,53
Neuseeland	0,50
Israel	0,48
Schweden	0,48
China	0,38
Irland	0,38
Australien	0,36
Österreich	0,35
Vereinigte Arabische Emirate	0,28
Belgien	0,27
Jersey	0,24
Singapur	0,23
Taiwan	0,14
Total	98,44

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	20,19
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	18,23
Elektronik und Halbleiter	7,59
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	4,83
Energie- und Wasserversorgung	4,56
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	3,96
Fahrzeuge	3,53
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	3,16
Verkehr und Transport	2,83
Einzelhandel und Warenhäuser	2,65
Banken und andere Kreditinstitute	2,49
Petroleum	2,41
Telekommunikation	2,35
Edelmetalle und Edelsteine	2,11
Biotechnologie	2,01
Immobilien	1,95
Grafikverlags- und Druckmedien	1,88
Diverse Dienstleistungen	1,88
Chemie	1,48
Elektrische Geräte und Komponenten	1,38
Verschiedene Konsumgüter	1,07
Luft- und Raumfahrtindustrie	0,84
Computerhardware und Netzwerk	0,82
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,78
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,75
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	0,48
Gesundheits- und Sozialdienste	0,45
Baustoffe und Bauindustrie	0,36
Nichteisenmetalle	0,34
Tabak und alkoholische Getränke	0,32
Gummi und Reifen	0,29
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,25
Verschiedene Handelsunternehmen	0,23
Total	98,44

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
USD HUBSPOT	481	203.833,37	0,15
Total Aktien		203.833,37	0,15
Anleihen			
USD 3D SYSTEMS CORP CV 0%/21-151126	250.000	171.660,00	0,12
USD AAON SEMICONDUCTOR CORP CV 0.5%/23-01032	2.300.000	2.019.975,00	1,45
USD ABU DHABI NATIONAL OIL CV 0.7%/21-040624	400.000	386.644,00	0,28
USD ADVANCED CV 144A 2.5%/23-150928	1.000.000	923.600,00	0,66
EUR AIR FRANCE-KLM SUB CV FF FRN/22-PERPET	500.000	530.936,39	0,38
USD AIRBNB INC CV 0%/21-150326	1.700.000	1.470.517,00	1,05
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC CV 0.375%/19-010927	1.200.000	1.221.480,00	0,88
USD ALARM.COM HLDGS INC CV 0%/21-150126	500.000	427.510,00	0,31
USD ALNYLAM PHARM 1%/22-150927	500.000	432.985,00	0,31
USD ALPHATEC HOLDINGS INC CV 0.75%/21-010826	200.000	170.352,00	0,12
EUR AMADEUS IT GROUP SA CV 1.5%/20-090425	300.000	349.047,83	0,25
EUR AMERICA MOVIL BV CV 0%/21-020324	1.500.000	1.639.755,81	1,18
USD AMPHASTAR PHAR 144A 2%/23-150329	500.000	489.415,00	0,35
JPY ANA HOLDINGS INC CV 0%/21-101231	150.000.000	1.094.456,49	0,78
EUR ANLLIAN CAPITAL LTD CV 0%/20-050225	1.000.000	1.130.672,90	0,81
USD APOLLO GLOBAL S A CV 6.75%/23-310726	15.000	721.650,00	0,52
USD ASCENDIS PHARMA 2.25%/22-010428	400.000	354.780,00	0,25
USD AXON ENTERPRISE 0.5%/22-151227	800.000	661.896,00	0,48
USD BANK OF AMERICA CORP S L CV 7.25%/PERPET	600	631.920,00	0,45
EUR BARCLAYS BANK PLC CV 0%/22-240125	400.000	405.076,22	0,29
EUR BASIC-FIT NV CV 1.5%/21-170628	300.000	273.435,33	0,20
EUR BE SEMICONDUCTOR CV 1.875%/22-060429	600.000	711.724,61	0,51
USD BENTLEY SYSTEMS CV 0.375%/21-010727	1.500.000	1.273.560,00	0,91
USD BHARTI AIRTEL LTD CV 1.5%/20-170225	500.000	745.470,00	0,53
USD BIGCOMMERCE HOLDINGS INC CV 0.25%/011026	200.000	157.004,00	0,11
USD BILL.COM HOLDINGS INC CV 0%/21-010427	400.000	316.688,00	0,23
USD BLOOM ENERGY CORP CV 144A 3%/23-010628	400.000	345.344,00	0,25
USD BOOKING HOLDINGS INC CV 0.75%/20-010525	600.000	914.382,00	0,66
USD BOSIDENG INTERNATIONAL CV 1%/19-171224	400.000	386.120,00	0,28
USD BOX INC CV 0%/21-150126	300.000	328.104,00	0,24
USD BRIDGEBIO PHARMA INC CV 2.5%/20-150327	300.000	283.932,00	0,20
USD BW OFFSHORE LTD CV 2.5%/19-121124	200.000	188.002,00	0,13
USD CABLE ONE INC CV 1.125%/21-150328	500.000	370.825,00	0,27
HKD CATHAY PACIFIC FIN III 2.75%/21-050226	14.000.000	1.816.497,17	1,30
EUR CELLNEX TELECOM S.A. CV 0.5%/19-050728	1.000.000	1.012.204,34	0,73
USD CERVEL THERAP HLD S 2.5%/22-150827	250.000	211.602,50	0,15
USD CERIDIAN HCM HOLDING CV 0.25%/21-150326	500.000	434.780,00	0,31
USD CHART INDUSTRIES IN B CV 6.75%/22-151225	5.000	245.800,00	0,18
USD CHINA HONGQIAO GROUP CV 5.25%/21-250126	400.000	478.672,00	0,34
USD CIE GEN ETABLIS MICHELIN CV 0%/18-101123	400.000	399.324,00	0,29
HKD CITIGROUP GLOB MK L S960 CV 0%/20-250724	5.000.000	609.571,26	0,44
USD CITIGROUP GLOB MKT FND L CV 0%/23-150328	200.000	217.750,46	0,16
USD CLOUDFLARE INC CV 0%/21-150826	1.000.000	938.350,00	0,60
USD CMS ENERGY CORP 3.375%/23-010528	1.000.000	846.380,00	0,68
USD COINBASE GLOBAL INC CV 0.5%/21-010626	500.000	379.090,00	0,27
USD CONFLUENT INC CV 0%/21-150127	700.000	562.800,00	0,40
USD CONMED CORP CV 2.25%/22-150627	600.000	506.022,00	0,40
USD CRACKER BARREL CV 0.625%/21-150626	300.000	248.214,00	0,18
USD CYBERARK SOFTWARE LTD CV 0%/19-151124	200.000	228.678,00	0,16
USD CYTOKINETICS INC CV 3.5%/22-010727	200.000	184.452,00	0,13
JPY DAINIPPON SCREEN MFG CO CV 0%/18-110625	30.000.000	240.790,33	0,17
USD DATADOG INC CV 0.125%/20-150625	300.000	330.051,00	0,24
EUR DELIVERY HERO AG CV 3.25%/23-210230	500.000	436.324,32	0,31
GBP DERWENT LONDON CAPITAL 3 CV 1.5%/120625	300.000	336.452,55	0,24
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG CV 2%/20-171125	500.000	522.469,82	0,37
USD DEXCOM INC CV 144A 0.375%/23-150528	1.200.000	1.057.788,00	0,76
EUR DIASORIN SPA CV 0%/21-050528	400.000	327.145,73	0,23
USD DIGITALOCEAN HOL CV 0%/21-011226	900.000	674.091,00	0,48
USD DISH NETWORK CORP CV 0%/20-151225	1.800.000	1.102.752,00	0,79
USD DROPBOX INC CV 0%/21-010328	500.000	463.175,00	0,33
USD DUKE ENERGY CORP CV 4.125%/23-150426	2.550.000	2.482.680,00	1,78
EUR EDENRED CV 0%/21-140628	5.000	329.720,58	0,24
EUR ELIS SA CV 2.25%/22-220929	400.000	475.561,21	0,34
USD ELM BV CV 3.25%/18-130624	400.000	466.784,00	0,33
USD ENVESTNET INC CV 144A 2.625%/22-011227	500.000	427.515,00	0,31
USD ENVISTA HOLDINGS 1.75%/23-150828	500.000	432.240,00	0,31
USD EQT CORP CV 1.75%/20-010526	230.000	667.752,10	0,48
USD ETSY INC CV 0.125%/19-011026	800.000	794.768,00	0,57
USD EXACT SCIENCES CORP CV 144A 2%/23-010330	1.200.000	1.231.416,00	0,88
USD EZCORP INC CV 144A 3.75%/22-151229	500.000	484.000,00	0,35
USD FARFETCH LTD CV 3.75%/20-010527	200.000	96.814,00	0,07
EUR FASTIGHETS AB BALDER CV 3.5%/23-230228	400.000	382.223,88	0,27
USD FIRST MAJESTIC SILV CV 0.375%/21-150127	1.500.000	1.126.740,00	0,81
USD FISHER INC CV 144A 2.5%/21-150926	300.000	121.398,00	0,09
USD FIVE9 INC CV 0.5%/20-010625	400.000	365.432,00	0,26
AUD FLIGHT CENTRE LTD CV 1.625%/21-011128	400.000	230.165,08	0,16
AUD FLIGHT CENTRE LTD CV 2.5%/20-171127	400.000	276.934,06	0,20
USD FORD MOTOR COMPANY CV 0%/21-150326	1.300.000	1.185.847,00	0,85
EUR GEELY SWEDEN FINANCE AB CV 0%/19-190624	200.000	290.827,21	0,21
USD GIGABYTE TECHNOLOGY CO CV 0%/23-270728	200.000	190.392,00	0,14
EUR GLANBIA CO-OPERATIVE 1.875%/22-270127	500.000	526.972,64	0,38
USD GLENORE FUNDING LLC CV 0%/18-270325	600.000	628.344,00	0,45
EUR GN STORE NORD CV 0%/19-210524	400.000	409.004,04	0,29
USD GREENBRIER COS INC CV 2.875%/21-150428	250.000	216.470,00	0,16
USD GUARDANT HEALTH CV 0%/20-151127	700.000	474.467,00	0,34

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

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
USD GUIDEWIRE SOFTWARE INC CV 1.25%/18-150325	300.000	303.837,00	0,22	EUR SGL CARBON SE CV 5.75%/22-210927	200.000	205.284,12	0,15
USD HALOZYME THERAPEUTICS 1%/22-150828	500.000	438.975,00	0,31	USD SHOCKWAVE MEDICAL 1%/23-150828	750.000	726.570,00	0,52
USD HUAZHU GROUP LTD CV 3%/20-010526	200.000	224.572,00	0,16	EUR SHOPIFY INC CV 0.125%/20-01.11.2025	500.000	440.565,00	0,32
USD IAC FINANCECO 3 INC CV 2%/19-150130	1.000.000	811.950,00	0,58	EUR SIEMENS ENERGY CV 5.625%/22-140925	500.000	350.918,72	0,25
EUR IBERDROLA S IBE CV 0.8%/22-071227	300.000	306.559,60	0,22	EUR SILICON ON INSULATOR TEC CV 0%/20-011025	1.000	186.675,71	0,13
USD INFINERA CORP CV 3.75%/22-010828	250.000	195.145,00	0,14	USD SK HYNIX INC CV 1.75%/23-110430	1.200.000	1.448.160,00	1,04
USD INSIGHT ENTERPRISES INC CV 0.75%/19-1502	250.000	524.672,50	0,38	USD SNAP INC CV 0.125%/22-010328	1.500.000	1.025.895,00	0,74
USD INSMED INC CV 0.75%/21-010628	500.000	484.770,00	0,35	USD SOUTHERN CO CV 144A 3.875%/23-151225	1.000.000	982.160,00	0,70
USD INSULET CORP CV 0.375%/20-010926	400.000	370.332,00	0,27	USD SOUTHWEST AIRLINES CO CV 1.25%/20-010525	300.000	285.594,00	0,20
USD INTEGER HOLDING CV 144A 2.125%/23-150228	700.000	769.769,00	0,55	EUR SPIE SA CV 2%/23-170128	600.000	611.838,11	0,44
USD INTEGRA LIFESCIENCES HLD CV 0.5%/20-150825	400.000	360.280,00	0,26	USD SPLUNK INC CV 1.125%/18-150925	700.000	751.912,00	0,54
USD INTERDIGITAL INC CV 3.5%/16-010627	300.000	336.267,00	0,24	USD SPOTIFY USA INC CV 0%/21-150326	600.000	513.564,00	0,37
EUR INTL CONSOLIDATED CV 1.125%/21-180528	600.000	323.151,58	0,23	USD SSR MINING INC CV 2.5%/19-010439	1.200.000	1.241.940,00	0,89
USD IOYI INC CV 6.5%/23-150328	400.000	350.028,00	0,25	USD STEM INC CV 144A 4.25%/23-010430	200.000	1.394.460,00	1,01
USD IVANHOE MINES LTD CV 144A 2.5%/21-150426	500.000	573.075,00	0,41	USD STMICROELECTRONICS NV S B CV 0%/040827	1.000.000	1.029.360,00	0,74
USD IZZI INVESTMENTS I LTD CV 2.5%/20-150626	500.000	913.032,00	0,65	SGD STRAITS TRDING CO LTD CV 3.25%/23-130228	500.000	314.008,78	0,23
JPY JFE HOLDINGS INC CV 0%/23-280928	100.000.000	682.755,97	0,49	USD STRIDE INC CV 1.125%/20-010927	200.000	236.920,00	0,17
EUR JPMORGAN CHASE CV 0%/22-140125	1.000.000	1.054.336,36	0,76	USD SUNNOVA ENERGY CV 0.25%/21-011226	250.000	131.805,00	0,09
EUR JPMORGAN CHASE CV 0%/22-230425	200.000	226.248,74	0,16	USD SUNNOVA ENERGY CV 2.625%/22-150228	500.000	238.455,00	0,17
USD KBR INC CV 144A 2.5%/18-011123	150.000	354.948,00	0,25	EUR TAG IMMOBILIEN AG CV 0.625%/20-270826	300.000	262.885,41	0,19
HKD KINGSOFT CORP LTD CV 0.625%/20-290425	2.000.000	264.064,69	0,19	JPY TAKASHIMAYA CO LTD CV 0%/18-061228	40.000.000	293.001,36	0,21
EUR LAGFIN SCA CV 3.5%/23-080628	300.000	301.368,67	0,22	USD TRANSMEDICS GROUP CV 1.5%/23-010628	500.000	385.715,00	0,28
USD LANTHEUS HOLDINGS 2.625%/22-151227	300.000	332.613,00	0,24	USD TRANSOCEAN INC CV 144A 4.625%/22-300929	100.000	215.150,00	0,15
EUR LEG IMMOBILIEN AG CV 0.4%/20-300628	500.000	408.319,10	0,29	USD TRIPADVISOR INC CV 144A 0.25%/21-010426	400.000	340.128,00	0,24
USD LENOVO GROUP LTD CV 2.5%/22-260829	600.000	988.760,00	0,69	USD TYLER TECHNOLOGIES CV 0.25%/21-150326	400.000	379.792,00	0,27
USD LG CHEM LTD CV 1.25%/23-180728	600.000	562.560,00	0,40	EUR UBISOFT ENTERTAINMENT CV 2.375%/22-151128	300.000	327.443,80	0,23
USD LG CHEM LTD CV 1.6%/23-180730	1.000.000	905.190,00	0,65	USD UNITED STATES STEEL CORP CV 5%/19-011126	200.000	512.924,00	0,37
USD LI AUTO INC CV 0.25%/21-010528	600.000	813.402,00	0,58	USD UNITY SOFTWARE 0%/21-151126	1.000.000	782.610,00	0,56
USD LIBERTY MEDIA CORP CV 2.25%/22-150827	600.000	596.586,00	0,43	USD UNIVERSE TREK LTD CV 0%/21-150626	300.000	297.264,00	0,21
USD LIBERTY MEDIA CORP CV 2.75%/19-011249	500.000	280.137,00	0,20	USD UNIVERSE TREK LTD CV 2.5%/20-080725	200.000	187.284,00	0,13
HKD LINK CB LTD CV 4.5%/22-121227	4.000.000	201.085,45	0,14	USD UPSTART HOLDINGS CV 0.25%/21-150826	300.000	190.605,00	0,14
USD LITHIUM AMERICAS CV 1.75%/21-150127	300.000	201.984,00	0,14	USD UPWORK INC CV 144A 0.25%/21-150826	500.000	409.730,00	0,29
USD LIVE NATION ENTERTAL CV 3.125%/23-150129	1.300.000	1.309.191,00	0,94	USD VAIL RESORTS INC CV 0%/20-010126	700.000	610.386,00	0,44
USD LUCID GROUP INC CV 144A 1.25%/21-151226	1.000.000	550.470,00	0,39	USD VENTAS REALTY LP CV 3.75%/23-010626	400.000	393.320,00	0,28
USD LUMENTUM HOLDINGS 1.5%/23-151229	150.000	124.140,00	0,09	EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA CV 0%/19-010125	10.000	318.653,79	0,23
USD LUMENTUM HOLDINGS INC CV 0.5%/19-151226	1.000.000	815.210,00	0,58	USD VERINT SYSTEMS INC CV 0.25%/21-150426	250.000	210.747,50	0,15
USD LUMENTUM HOLDINGS INC CV 0.5%/22-150628	250.000	174.440,00	0,13	EUR VERISTALPINE AG CV 2.75%/23-280428	500.000	485.987,46	0,35
USD LUMINAR TECH CV 144A 1.25%/21-151226	300.000	174.672,00	0,13	USD WAYFAIR INC CV 1%/19-150826	800.000	602.184,00	0,43
USD LYFT INC CV 1.5%/20-150525	500.000	457.800,00	0,33	USD WAYFAIR INC CV 3.25%/22-150927	500.000	481.295,00	0,34
USD M/A-COM TECH SOLUTION CV 0.25%/21-150326	600.000	624.090,00	0,45	USD WEIMOB INVESTMENT LTD CV 0%/21-070626	400.000	374.968,00	0,27
USD MARATHON DIGITAL CV 1%/21-011226	400.000	287.512,00	0,21	USD WELLTOWER CV 144A 2.75%/23-150528	750.000	770.175,00	0,55
USD MARRIOTT CV 144A 3.25%/22-151227	700.000	593.208,00	0,43	EUR WENDEL SE CV 2.625%/23-270326	400.000	404.509,67	0,29
USD MEITUAN CV/21-270428	1.000.000	833.800,00	0,60	USD WOLFSPEED INC CV 1.875%/22-011229	2.000.000	1.193.140,00	0,86
EUR MERRILL LYNCH BV CV 0%/23-300126	300.000	331.144,36	0,24	USD WORKIVA INC CV 144A 1.25%/23-150828	350.000	317.457,00	0,23
USD MGP INGREDIENTS INC CV 1.875%/21-151141	400.000	452.164,00	0,32	EUR WORLDLINE SA/FRANCE CV 0%/19-30.07.2026	5.000	460.751,59	0,33
USD MICROSTRATEGY INC CV 0.75%/20-151225	1.000.000	1.248.360,00	0,89	USD XERO INVESTMENTS LTD CV 0%/20-021225	800.000	696.584,00	0,50
USD MIDDLEBY CORP CV 1%/20-010925	400.000	414.736,00	0,30	USD XOMETRY INC CV 1%/22-010227	500.000	335.715,00	0,24
USD MONGDB INC CV 0.25%/20-150126	400.000	682.060,00	0,49	EUR ZALANDO SE CV 0.625%/20-060827	800.000	696.013,36	0,50
USD MP MATERIALS COR CV 144A 0.25%/21-010426	750.000	617.437,50	0,44	EUR ZHEJIANG EXPRESSWAY CO CV 0%/21-200126	500.000	535.634,75	0,38
USD NCL CORP LTD CV 144A 1.125%/21-150227	500.000	387.375,00	0,28	HKD ZHONGSHENG GROUP CV 0%/20-210525	3.000.000	398.807,71	0,29
EUR NEOEN SAS CV 2.875%/22-140927	200.000	186.594,32	0,13	USD ZIFF DAVIS INC CV 1.75%/19-011126	500.000	481.295,00	0,32
USD NEOGENOMICS INC CV 0.25%/21-150128	300.000	215.856,00	0,15	USD ZILLOW GROUP INC CV 1.375%/19-010926	400.000	419.020,00	0,30
EUR NEXI SPA CV 0%/21-240228	800.000	682.678,25	0,49	USD ZSCALER CV 0.125%/20-010725	600.000	731.832,00	0,52
EUR NEXI SPA CV 1.75%/20-240427	500.000	467.320,84	0,33	USD ZTO EXPRESS KY INC CV 1.5%/22-010927	500.000	480.910,00	0,34
USD NEXTERA CV 144A 2.5%/22-150626	750.000	650.580,00	0,47	Total Anleihen	133.754.292,74	95,87	
USD NEXTERA ENERGY INC CV 6.926%/22-010925	15.000	563.100,00	0,40	Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere	133.958.126,11	96,01	
USD NICE LTD CV 0%/20-150925	500.000	445.000,00	0,32	Nicht börsennotierte Wertpapiere			
USD NIO INC CV 144A 3.875%/23-151029	250.000	223.212,50	0,16	Anleihen			
USD NIO INC CV 144A 4.625%/23-151030	250.000	222.745,00	0,16	JPY AICA KOGYO CO LTD CV 0%/22-220427	20.000.000	146.978,74	0,11
JPY NIPPON STEEL CORP CV 0%/21-051026	200.000.000	1.761.616,04	1,26	EUR DAIFUKU CO CV 0%/23-140928	40.000.000	272.304,74	0,20
USD NISOURCE INC CV 7.75%/21-010324	6.000	608.940,00	0,44	EUR ENI SPA CV 0%/23-140930	1.000.000	1.078.816,48	0,77
USD NORTHERN OIL GAS 3.625%/22-150429	750.000	885.270,00	0,63	JPY FERROTEC HOLDINGS 0%/23-230628	100.000.000	682.465,43	0,49
GBP OCADO GROUP PLC CV 0.75%/20-180127	600.000	513.446,81	0,37	USD MODEL N INC CV 1.875%/23-150328	750.000	665.992,50	0,48
USD OKTA INC CV 0.375%/20-150626	1.000.000	856.990,00	0,61	JPY SENKO GROUP HOLDINGS CO CV 0%/21-180325	30.000.000	202.249,62	0,14
EUR OLIVER CAPITAL SARL CV 0%/20-291223	1.000.000	1.048.279,75	0,75	JPY YAOOKO CO CV 0%/19-200624	40.000.000	340.788,99	0,24
USD OMNICELL INC CV 0.25%/20-150925	600.000	532.938,00	0,38	Total Anleihen	3.389.596,50	2,43	
USD ORMAT TECHNOLOGIES INC CV 2.5%/22-150727	250.000	226.695,00	0,16	Nicht börsennotierte Wertpapiere			
USD PACIRA PHARMACEUTICALS CV 0.75%/20-010825	600.000	538.524,00	0,39	Total des Wertpapierbestandes	137.347.722,61	98,44	
USD PAGERDUTY INC CV 144A 1.5%/23-151028	500.000	490.605,00	0,35	Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.660.179,52	2,62
USD PALO ALTO NETWORKS CV 0.375%/20-010625	900.000	2.197.539,00	1,58	Andere Passiva		-1.484.832,02	-1,06
USD PARSONS CORP CV 0.25%/20-150825	300.000	393.249,00	0,28	Teilfondsvermögen		139.523.070,11	100,00
USD PEGASYS INC CV 0.75%/20-010325	500.000	458.465,00	0,33				
USD PERFICIENT INC CV 0.125%/21-151126	750.000	599.805,00	0,43				
USD PIONEER NATURAL RESOURCE CV 0.25%/20-150525	500.000	1.274.750,00	0,91				
EUR PIRELLI & C SPA CV 0%/20-221225	600.000	591.194,90	0,42				
USD POST HOLDINGS INC CV 2.5%/22-150827	700.000	666.512,00	0,48				
USD PROGRESS SOFTWARE CORP CV 1%/21-150426	600.000	608.400,00	0,44				
EUR PRYSMIAN SPA CV 0%/21-020226	700.000	759.019,02	0,54				
USD Q2 HOLDINGS INC CV 0.75%/19-010626	200.000	173.178,00	0,12				
USD RBC BEARINGS INC S A CV 5%/21-151024	5.000	525.950,00	0,38				
USD REALOGY GROUP/CO-ISSUER CV 0.25%/21-1506	250.000	186.050,00	0,13				
USD RIVIAN AUTO 144A 3.625%/23-151030	1.500.000	1.361.280,00	0,98				
JPY ROHM COMPANY LTD CV 0%/19-051224	50.000.000	332.414,34	0,24				
USD ROYAL CARIBBEAN CR CV 2.875%/20-151123	2.500.000	2.545.125,00	1,82				
USD SABRE GBLB INC CV 4%/20-150425	250.000	224.880,00	0,16				
EUR SAFRAN SA CV 0%/21-010428	10.000	1.869.811,86	1,34				
EUR SAFRAN SA CV 0.875%/20-150527	4.000	644.930,66	0,46				
EUR SAGERPAR CV 0%/21-010426	400.000	380.397,39	0,27				
HKD SAIL VANTAGE LTD CV 0%/22-130127	2.000.000	231.188,88	0,17				
EUR SAIPEM SPA CV 2.875%/23-110929	400.000	431.454,72	0,31				
USD SAREPTA THERAPEUTICS 1.25%/22-150927	700.000	595.707,00	0,43				
USD SASOL FINANCING US LLC CV 4.5%/22-081127	400.000	382.296,00	0,27				
JPY SBI HOLDINGS INC CV 0%/20-250725	60.000.000	472.650,69	0,34				
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE CV 0%/20-150626	2.270	428.948,55	0				

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	112092506	LU2352592658	0,90%	1,22%
B - Thesaurierend	USD	112108657	LU2352598341	0,90%	1,22%
DA - Ausschüttend	USD	112108665	LU2352594357	0,00%	/
DB - Thesaurierend	USD	112108666	LU2352594431	0,00%	0,12%
IA - Ausschüttend	USD	112060294	LU2352600261	0,45%	0,77%
IB - Thesaurierend	USD	112060289	LU2352600188	0,45%	0,77%
UA - Ausschüttend	USD	112108647	LU2352597293	0,55%	0,86%
UB - Thesaurierend	USD	112108680	LU2352597020	0,55%	0,87%
BH - Thesaurierend	EUR	112108655	LU2352598184	0,90%	1,30%
IBH - Thesaurierend	EUR	112060164	LU2352599828	0,45%	0,85%

Für die Aktienklassen -DA- und -DB- wird keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund -DA- wurde am 13.07.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022
A - Ausschüttend	USD	2,20%	-10,36%	-10,38%
B - Thesaurierend	USD	2,20%	-10,35%	-10,38%
DA - Ausschüttend	USD	/	-6,36%	-9,43%
DB - Thesaurierend	USD	3,12%	-8,28%	-9,43%
IA - Ausschüttend	USD	2,58%	-9,49%	-9,97%
IB - Thesaurierend	USD	2,58%	-9,49%	-9,97%
UA - Ausschüttend	USD	2,50%	-9,67%	-10,05%
UB - Thesaurierend	USD	2,50%	-9,68%	-10,06%
BH - Thesaurierend	EUR	0,36%	-14,07%	-12,30%
IBH - Thesaurierend	EUR	0,74%	-12,74%	-11,91%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	06.12.2022	0,61
A - Ausschüttend	USD	07.03.2023	0,76
A - Ausschüttend	USD	06.06.2023	0,70
A - Ausschüttend	USD	05.09.2023	0,79
DA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	8,66
DA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	10,23
DA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	9,47
IA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	7,15
IA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	8,49
IA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	7,97
IA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	8,85
UA - Ausschüttend	USD	06.12.2022	0,69
UA - Ausschüttend	USD	07.03.2023	0,83
UA - Ausschüttend	USD	06.06.2023	0,78
UA - Ausschüttend	USD	05.09.2023	0,86

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In USD)
EUR	1.291.200	USD	-1.363.604	09.11.2023	1.695,35
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.274.300	USD	-1.350.792	24.11.2023	-2.528,22
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften

-832,87

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.10.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		48.662.047,32			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		339.287,50			
Forderungen aus Erträgen		544.721,12			
		49.546.055,94			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		25.075,69			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		832,87			
		25.908,56			
Nettovermögen		49.520.147,38			
Teilfondsentwicklung					
		31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	
Teilfondsvermögen	USD	49.520.147,38	86.102.101,73	120.505.869,28	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	84,13	81,91	98,96	
B - Thesaurierend	USD	89,65	84,39	98,96	
DA - Ausschüttend	USD	/	842,60	/	
DB - Thesaurierend	USD	917,19	853,92	991,13	
IA - Ausschüttend	USD	842,15	819,91	990,09	
IB - Thesaurierend	USD	905,09	848,15	990,10	
UA - Ausschüttend	USD	84,21	81,98	99,00	
UB - Thesaurierend	USD	90,32	84,72	99,00	
BH - Thesaurierend	EUR	85,93	82,86	98,91	
IBH - Thesaurierend	EUR	872,61	837,74	995,44	
Anzahl der Aktien im Umlauf					
		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	46.015,061	71.637,164	7.165,880	32.787,983
B - Thesaurierend	USD	38.097,601	83.638,328	0,000	45.540,727
DA - Ausschüttend	USD	0,000	4.264,454	0,000	4.264,454
DB - Thesaurierend	USD	14.176,056	14.106,087	799,734	729,765
IA - Ausschüttend	USD	18.092,297	28.427,953	349,751	10.685,407
IB - Thesaurierend	USD	10.448,577	23.561,803	549,896	13.663,122
UA - Ausschüttend	USD	2.780,845	5.393,868	0,000	2.613,023
UB - Thesaurierend	USD	17.694,611	126.265,693	2.706,105	111.277,187
BH - Thesaurierend	EUR	14.460,906	20.697,235	1.293,315	7.529,644
IBH - Thesaurierend	EUR	1.509,235	1.704,235	0,000	195,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.11.2022 bis zum
31.10.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	86.102.101,73
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	3.134.837,92
Bankzinsen	48.576,55
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	62.583,80
	3.245.998,27
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	319.793,40
Depotbank- und Depotgebühr	39.525,06
Zentralverwaltungsvergütung	38.702,23
Druck- und Veröffentlichungskosten	16.979,65
Zinsen und Bankspesen	1.971,18
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.*	66.752,19
"Taxe d'abonnement"	25.612,79
	509.336,50
Nettoerträge (-verluste)	2.736.661,77
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-5.981.709,27
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	159.307,89
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	270.349,73
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-48.186,16
	-5.600.237,81
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-2.863.576,04
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	8.469.737,83
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-49.420,49
	8.420.317,34
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	5.556.741,30
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	2.504.906,04
Rücknahmen	-43.664.477,98
	-41.159.571,94
Ausschüttung	-979.123,71
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	49.520.147,38

* Der Posten entspricht mehr als 10% der Gesamtkosten. Jährliche Aufsicht durch die CSSF und sonstige Berichtskosten gehören zu den Positionen, die am meisten ausmachen.

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Kaimaninseln	9,24
Vereinigte Staaten	8,55
Mexiko	7,87
Südkorea	6,64
Türkei	5,49
Britische Jungfernseln	5,37
Luxemburg	5,22
Grossbritannien	4,99
Indonesien	4,65
Kolumbien	3,37
Niederlande	3,36
Singapur	3,16
Indien	2,80
Mauritius	2,56
Vereinigte Arabische Emirate	2,50
Chile	2,45
Israel	2,35
Philippinen	2,16
Hongkong	2,12
Ukraine	1,83
Peru	1,41
Argentinien	1,30
Kanada	1,24
Ägypten	1,19
Japan	1,00
Bermudas	0,95
Usbekistan	0,91
Georgien	0,90
Nigeria	0,85
Kasachstan	0,76
Thailand	0,43
Südafrika	0,38
Irland	0,28
Total	98,27

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	27,41
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	25,42
Petroleum	8,39
Länder und Zentralregierungen	5,43
Telekommunikation	5,18
Immobilien	3,07
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	3,01
Chemie	2,89
Energie- und Wasserversorgung	2,60
Edelmetalle und Edelsteine	2,18
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,88
Supranationale Organisationen	1,19
Pharmazie, Kosmetik und med. Produkte	1,02
Computerhardware und Netzwerk	1,01
Elektrische Geräte und Komponenten	0,99
Elektronik und Halbleiter	0,98
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,96
Anlagefonds	0,96
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,91
Verschiedene Konsumgüter	0,61
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,50
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,43
Verkehr und Transport	0,38
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,36
Landwirtschaft und Fischerei	0,30
Baustoffe und Bauindustrie	0,19
Total	98,27

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD 10 RENEW POWER SUBSIDIAR 4.5%/21-140728	500.000	412.540,00	0,83
USD ACCESS BANK PLC 6.125%/21-210926	500.000	418.805,00	0,85
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BA 4.125%/17-20.06.2024	600.000	590.298,00	1,19
USD AKBANK TAS 6.8%/20-06.02.2026	250.000	243.202,50	0,49
USD ALPHA STAR HLD VII 7.75%/23-270426	250.000	245.470,00	0,50
USD ALPHA STAR HOLDING 8.375%/23-120427	300.000	298.761,00	0,60
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL 3.625%/17-110924	500.000	488.740,00	0,99
USD ARABIAN CENTRES SUKUK 5.625%/21-071026	400.000	359.800,00	0,73
USD ARAGVI FINANCE INTL 8.45%/21-290426	200.000	137.182,00	0,28
USD ARCELIK AS 8.5%/23-250926	300.000	299.910,00	0,61
USD AJINA SA 6.5%/20-20.11.2025	600.000	549.624,00	1,11
USD BAIDU INC 1.72%/20-03.04.2026	250.000	227.077,50	0,46
USD BANCO SANTANDER CHILE 2.7%/20-100125	500.000	480.570,00	0,97
USD BANCO SANTANDER MEXICO 5.375%/20-17.04.2025	750.000	737.062,50	1,49
USD BANCO SANTANDER MEXICO SUB FF FRN/011026	500.000	499.065,00	1,01
USD BANK LEUMI LE-ISRAEL FF FRN/20-290131	400.000	342.536,00	0,69
USD BANK OF EAST ASIA LTD (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-29.05.2030	600.000	553.038,00	1,12
USD BANK OF GEORGIA JSC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	450.000	446.616,00	0,90
USD BANK OF PHILIPPINE ISLAN 2.5%/19-10.09.2024	600.000	580.866,00	1,17
USD BANK RAKYAT INDONESIA 3.95%/19-28.03.2024	200.000	198.250,00	0,40
USD BEVA BANCOMER SA TEXAS 1.875%/20-18.09.2025	500.000	460.280,00	0,93
USD BEVA BANCOMER SA TEXAS 4.375%/14-10.04.2024	500.000	495.305,00	1,00
USD BIMBO BAKERIES USA INC 6.05%/23-150129	500.000	500.170,00	1,01
USD BOC AVIATION LTD 2.75%/20-02.12.2023	500.000	498.585,00	1,01
USD BRASKEM NETHERLANDS 8.5%/23-120131	200.000	186.988,00	0,38
USD CAMPOSOL SA 6%/20-030227	250.000	148.387,50	0,30
USD CANACOL ENERGY LTD 5.75%/21-241128	400.000	288.588,00	0,58
USD CENTRAL PLAZA DEV LTD 3.85%/20-140725	300.000	211.542,00	0,43
USD COSAN LUXEMBOURG 7.5%/23-270630	300.000	292.887,00	0,59
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LT 8%/23-250229	200.000	196.850,00	0,40
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD SUB FF FRN/100331	500.000	453.200,00	0,92
USD DIGICEL REG S 6.75%/15-010323	1.000.000	34.790,00	0,07
USD DOHA FINANCE LIMITED 2.375%/21-310326	500.000	453.140,00	0,92
USD ECOPETROL SA 8.625%/23-190129	700.000	699.818,00	1,41
USD ENDEAVOUR MINING PLC 5%/21-14.10.26	200.000	176.362,00	0,36
USD ENERGEAN ISRAEL FIN S 2 4.875%/21-300326	400.000	352.920,00	0,71
USD ENN CLEAN ENERGY 3.375%/21-120526	400.000	367.424,00	0,74
USD FIRST QUANTUM MINERALS L 6.875%/18-01.03.2026	200.000	176.054,00	0,36
USD FLEXTRONICS INTERNATIONAL 4.75%/16-15.06.2025	500.000	487.925,00	0,99
USD FORTUNE STAR BV LTD 6.85%/20-02.07.2024	250.000	226.225,00	0,46
USD FRANSION BRILLIANT LTD 3.2%/21-090426	200.000	147.712,00	0,30
USD FRONTERA ENERGY CORP 7.875%/21-210628	200.000	151.574,00	0,31
USD FS LUXEMBOURG SARL 10%/20-15.12.2025	200.000	204.690,00	0,41
USD GENNEIA SA 8.75%/21-020927	500.000	380.200,00	0,77
USD GEOPARK LTD 5.5%/20-17.01.2027	300.000	252.897,00	0,51
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES 3.875%/15-04.06.2025	200.000	123.342,00	0,25
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLD 5.125%/19-15.05.2024	1.250.000	1.241.812,50	2,51
USD GRAN TIERRA ENERGY INC 9.5%/23-151029	333.000	286.340,04	0,58
USD GREENKO DUTCH BV 3.85%/21-290326	600.000	496.347,60	1,00
USD GRUPO BIMBO REG S 3.875%/14-270624	1.000.000	988.310,00	2,00
USD GRUPOSURA FINANCE (REG. -S-) 5.5%/16-29.04.2026	400.000	376.564,00	0,76
USD HANA BANK REG S 4.375%/14-300924	300.000	294.615,00	0,59
USD HIKMA FINANCE USA LLC 3.25%/20-09.07.2025	250.000	234.890,00	0,47
USD HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/21-221124	500.000	498.540,00	1,01
USD HUARONG FINANCE II 5%/19-11-11-2025	400.000	369.684,00	0,75
USD IHS HOLDING LTD 5.625%/21-291126	900.000	728.757,00	1,47
USD INDIA TOLL ROADS 5.5%/21-190824	300.000	292.641,00	0,59
USD INVERSIONES CMPC (REG. -S-) 4.75%/14-15.09.2024	250.000	246.477,50	0,50
USD IPOTEKA-BANK ATIB 5.5%/20-19.11.2025	500.000	452.915,00	0,91
USD KASKORNBANK PCL HK SUB FF FRN/21-PERPET	250.000	213.570,00	0,43
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (REG. -S-) 4.75%/17-19.04.2027	400.000	374.040,00	0,76
USD KENBOURNE INVEST SA 6.875%/19-261124	382.000	288.742,34	0,58
USD KOC HOLDING AS 6.5%/19-110325	250.000	247.645,00	0,50
USD KOSMOS ENERGY LTD 7.125%/19-04.04.2026	200.000	185.458,00	0,37
USD KOSMOS ENERGY LTD 7.5%/21-010328	500.000	438.025,00	0,88
USD LAMAR FUNDING REG S 3.958%/15-070525	500.000	477.635,00	0,96
USD LENOVO GROUP LTD 5.875%/20-240425	500.000	498.410,00	1,01
USD LEVIATHAN BOND LTD 144A 6.125%/20-300625	500.000	466.465,00	0,94
USD LG CHEM LTD 4.375%/22-140725	400.000	389.336,00	0,79
USD LIQUID TELECOM FINANCE 5.5%/21-040926	200.000	123.448,00	0,25
USD LONGFOR HOLDINGS LTD 3.375%/20-130427	200.000	86.918,00	0,18
USD MASHREQBANK PSC 4.25%/19-26.02.2024	1.000.000	991.970,00	2,00
USD MC BRAZIL DWNSTRM 7.25%/21-300631	200.000	137.497,60	0,28
USD MILICOM INTL CELLULAR 6.25%/19-250329	500.000	392.008,50	0,79
USD MINERVA LUXEMBOURG SA 4.375%/21-180331	400.000	309.768,00	0,63
USD MIRAE ASSET DAEWOO CO 2.625%/20-300725	700.000	653.107,00	1,32
USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP FF FRN/23-200226	500.000	496.910,00	1,00

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 Short Duration Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettvermö- gens
USD MIZUHO BANK REG S 4.6%/14-270324	1.000.000	992.540,00	2,00
USD MTN MAURITIUS INVST 4.755%/14-111124	1.000.000	973.370,00	1,97
USD MX REMIT FUND FIDUC EST 4.875%/21-15.01.2028	550.000	413.083,00	0,83
USD NEXA RESOURCES SA 5.375%/17-040527	200.000	183.958,00	0,37
USD PERUSAHAAN GAS NEGARA (REG. -S-) 5.125%/14-16.05.2024	200.000	199.012,00	0,40
USD PHILIPPINE NATIONAL BANK 3.28%/19-27.09.2024	500.000	487.040,00	0,98
USD POWER FINANCE CORP LTD 3.25%/19-16.09.2024	1.000.000	975.070,00	1,97
USD PROSUS N.V. 3.257%/22-190127	800.000	706.096,00	1,43
USD PT BANK MANDIRI (PERSERO) TBK 3.75%/19-11.04.2024	500.000	494.910,00	1,00
USD PT BANK MANDIRI (PERSERO) TBK 4.75%/20-13.05.2025	250.000	245.455,00	0,50
USD PT BANK NEGARA TBK SUB 3.75%/21-300326	500.000	460.890,00	0,93
USD PT FREEPORT INDONESIA 4.763%/22-140427	500.000	474.010,00	0,96
USD PUMA INTERNATIONAL FINAN 5%/18-24.01.2026	400.000	360.520,00	0,73
USD QNB FINANCE LTD 3.5%/19-28.03.2024	500.000	494.570,00	1,00
USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.2%/21-12.01.2026	300.000	95.847,00	0,19
USD SHINHAN BANK SUB REG S 3.875%/16-240326	500.000	473.215,00	0,96
USD SHUI ON DEVELOPMENT HLDG 5.5%/20-03.03.2025	500.000	260.245,00	0,53
USD SK HYUNIK INC 3%/19-170924	500.000	486.005,00	0,98
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINER 4.375%/14-28.01.2025	500.000	488.315,00	0,99
USD STANDARD CHARTERED PLC FF FRN/20-300126	400.000	380.948,00	0,77
USD STANDARD CHARTERED PLC FF FRN/21-231125	500.000	473.960,00	0,96
USD STILLWATER MINING CO 4%/21-161126	500.000	431.555,00	0,87
USD SUAM FINANCE (REG -S-) 4.875%/14-17.04.2024	600.000	593.652,00	1,20
USD TELECOM ARGENTINA SA 8.5%/20-06.08.2025	400.000	261.688,60	0,53
USD TENGIZCHEVROIL FIN CO IN 2.625%/20-15.08.2025	200.000	180.634,00	0,36
USD TEVA PHARMACEUTICALS NE 4.75%/21-090527	300.000	272.349,00	0,55
USD TOTAL PLAY TELECOM 6.375%/21-200928	501.000	240.930,90	0,49
USD TOWER BERSAMA 2.75%/21-200126	250.000	229.120,00	0,46
USD TRANSNET SOC LTD 8.25%/23-060228	200.000	189.336,00	0,38
USD TRUST F/1401 5.25%/15-30.01.2026	500.000	477.300,00	0,96
USD TULLOW OIL PLC 10.25%/21-150526	200.000	172.498,00	0,35
USD TULLOW OIL PLC 7%/18-010325	200.000	157.374,00	0,32
USD TUPRAS-TURKIYE PETROL RA 4.5%/17-18.10.2024	250.000	242.845,00	0,49
USD TURK IHRACAT KR BK 9%/23-280127	500.000	501.120,00	1,01
USD TURK TELEKOMUNIKASYON 4.875%/14-190624	300.000	293.724,00	0,59
USD TURKCELL REG S 5.75%/15-151025	400.000	384.512,00	0,78
USD TURKIYE SINAI A.S. 9.375%/23-191028	300.000	305.283,00	0,62
USD TURKIYE VAKIFLAR T.A.O. 9%/23-121028	200.000	199.580,00	0,40
USD UKRAINE (REG. -S-) 7.75%/15-01.09.2023	800.000	248.072,00	0,50
USD UKRAINE (REG. -S-) 7.75%/15-01.09.2026	1.000.000	283.340,00	0,57
USD VFU FUNDING (VF UKRAINE) 6.2%/20-110225	500.000	374.175,00	0,76
USD WOORI BANK REG S T 3 SUB 4.75%/14-300424	1.000.000	992.060,00	2,00
Total Anleihen		46.506.313,58	93,91
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		46.506.313,58	93,91
Geldmarktinstrumente			
USD TREASURY BILL 0%/23-040124	700.000	693.271,07	1,40
USD TREASURY BILL 0%/23-160524	500.000	485.598,26	0,98
USD WI TREASURY BILL 0%/23-040424	1.000.000	976.864,41	1,97
Total Geldmarktinstrumente		2.155.733,74	4,35
Total des Wertpapierbestandes		48.662.047,32	98,27
Bareinlagen bei Banken und Brokern		339.287,50	0,69
Andere Nettvermögenswerte		518.812,56	1,04
Teilfondsvermögen		49.520.147,38	100,00

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

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) 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 516.535,07
Vergütung an andere Mitarbeiter, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der verwalteten Fonds haben	k.A. (*)

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

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 entrichtet vom OGAW-Fonds an 2 Empfänger	CHF 23.205,08, bestehend aus: - CHF 23.205,08 feste Vergütung - CHF 0 variable Vergütung
<i>Umfasst:</i>	
Vergütung der Geschäftsleitung	CHF 23.205,08
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 Verwaltungsrathonoraren, die an die Verwaltungsratsmitglieder gezahlt werden, einschliesslich Gehälter und Zuwendungen. Die variable Vergütung besteht aus jährlichen Bonuszahlungen, die gemäss der Vergütungspolitik gezahlt werden, einschliesslich der direkt vom Fonds an die Mitarbeiter entrichteten Vergütung, z. B. durch etwaige Performancegebühren.

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

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

Vergütung von Vertretern für das Geschäftsjahr zum 31. Oktober 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 31. Oktober 2023, die vom OGAW an Vertreter (Tätigkeiten des Portfoliomanagements und des Risikomanagements) gezahlt wurde.	CHF 7.775.938,55 Bestehend aus: - CHF 7.775.938,55 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") und Total-Return-Swaps ("TRS")**Arten von SFT und TRS**

Zum 31. Oktober 2023 waren keine Subfonds 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 31.10.2023 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 jede Art von SFT angelegt ist, die Gegenparteien, die Angaben zu den Sicherheiten und die Rendite- und Kostenangaben sind in den Erläuterungen dieses Jahresberichts enthalten.

Subfonds	Währung	Umfang der entliehenen Wertpapiere als Anteil am gesamten verleihbaren Vermögen (in %)*	Umfang der verliehenen Wertpapiere als Anteil am Nettovermögen (in %)
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)	USD	5,97	5,73
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	EUR	9,06	8,50
Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund	EUR	13,54	13,34
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	USD	9,01	8,62
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	USD	5,69	5,47
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	USD	6,54	6,27
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	USD	9,80	9,50
Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund	USD	4,64	4,28
Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund	USD	4,86	4,78
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	USD	22,83	22,48
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	USD	2,42	2,39
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund	USD	10,86	10,67

* 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:

Sicherheitsemittent	Gesamtes Volumen der erhaltenen Sicherungswertpapiere und Rohstoffe pro Emittent auf Sammelkontoebene (in CHF)
NVIDIA CORP	68.419.498,71
FRANCE (GOVT OF)	63.457.330,36
EUROPEAN UNION	48.597.004,91
NESTLE SA-REG	45.723.600,00
REPUBLIC OF AUSTRIA	42.245.618,37
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	37.672.961,34
MICROSOFT CORP	25.030.277,87
EURO STABILITY MECHANISM	23.454.928,26
APPLE INC	21.962.532,17
AMAZON.COM INC	18.768.750,94

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

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)	5,18%
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	3,54%
Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)	0,00%
Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund	4,01%
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	6,25%
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	2,12%
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	2,68%
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	0,47%
Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund	0,04%
Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund	2,75%
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	3,97%
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	0,40%
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund	0,64%

Fälligkeit der Sicherheiten in Verbindung mit SFT

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 Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (vorher Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund)	USD	0,00	0,00	0,00	975.908,88	2.297.945,10	16.671.857,20	25.033.112,79
Credit Suisse (Lux) Financial Bond Fund	EUR	0,00	0,00	0,00	631.307,08	1.486.520,98	10.784.881,44	16.193.705,97
Credit Suisse (Lux) Credit Special Situation Fund (bis zum 21.07.2023)	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund	EUR	0,00	0,00	0,00	715.057,59	1.683.725,95	12.215.626,28	18.341.996,75
Credit Suisse (Lux) Global High Yield Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	1.178.040,24	2.773.898,12	20.124.951,32	30.217.999,72
Credit Suisse (Lux) Global Inflation Linked Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	398.468,03	938.261,43	6.807.195,05	10.221.133,70
Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund	USD	0,00	0,00	0,00	504.091,68	1.186.970,45	8.611.607,75	12.930.493,92
Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	88.455,57	208.283,83	1.511.123,27	2.268.980,52
Credit Suisse (Lux) High Yield USD Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	7.359,11	17.328,28	125.718,69	188.769,03
Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	518.402,75	1.220.668,33	8.856.089,74	13.297.588,31
Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	747.991,84	1.761.275,29	12.778.255,74	19.186.795,64
Credit Suisse Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	75.984,42	178.918,38	1.298.073,48	1.949.082,19
Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	120.606,38	283.988,44	2.060.368,92	3.093.683,38

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

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

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

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

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Convertible Bond Fund (bis zum 08.12.2022) **Rechtsträgerkennung (LEI):** I51Y7ZVY5MA52YMZ8203

Credit Suisse Investment Partners (Lux) Global Investment Grade Convertible Bond Fund (per 09.12.2022)

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.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel ___% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel ___% getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 28,21% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,74%, AA: 32,09%, A: 30,46%, BBB: 8,15%, BB: 8,43%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,31%, Keine Datenabdeckung**: 0,83%	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	5,80	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,35	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,00	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 42,17%, Gelb: 34,69%, Orange: 18,56%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar** ² : 4,31%, Keine Datenabdeckung** ² : 0,28%	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: 47,18%, Neutral: 47,16%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar** ² : 0,00%, Keine Datenabdeckung** ² : 5,66%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 8,64%, AA: 25,23%, A: 35,57%, BBB: 18,65%, BB: 6,60%, B: 1,44%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar** ² : 2,87%, Keine Datenabdeckung** ² : 1,00%	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	5,02	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,35	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,84	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 48,75%, Gelb: 32,91%, Orange: 10,02%, Rot: 1,65%, Nicht bewertbar** ² : 5,67%, Keine Datenabdeckung** ² : 1,00%	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: 32,38%, Neutral: 58,24%, Negativ: 1,44%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 7,94%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, 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 genehmigt.

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

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

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

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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

Investitionen dürfen:

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

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

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde 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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	139.227,05	96,41	96,41
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	21.647,66	96,41	96,41
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	458.451,00	96,41	96,41
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	618.368,18	96,41	96,41
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	801,42	96,41	96,41
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	1.357,54	96,41	96,31
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	16,68	96,41	95,79
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	59,82	96,41	78,11
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,41	87,20
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	96,41	87,20
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,38	96,41	87,20
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,42	96,41	87,20
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,05	96,41	87,20
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,41	87,20
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,41	87,20
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,20	96,41	87,20
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	96,41	87,20
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,50	96,41	95,79
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	96,41	1,04
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,25	96,41	45,46
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	96,41	96,35
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global	38,54	96,41	95,75

Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)			
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,26	96,41	18,18
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	30,93	96,41	95,79
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	96,41	95,79
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	5,62	1,86	1,86
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	1,86	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	1,86	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
NIPPON STEEL CORPORATION / 05.10.2026	C. Verarbeitendes Gewerbe	4,71	Japan
AMERICA MOVIL BV / 02.03.2024	J. Information und Kommunikation	3,50	Niederlande
AKAMAI TECH INC / 1,125% / 15.02.2029	J. Information und Kommunikation	3,45	USA
SK HYNIX INC / 1,750% / 11.04.2030	C. Verarbeitendes Gewerbe	3,39	Südkorea, Republik
MEITUAN / 27.04.2028	G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,00	China
SAFRAN SA / 0,875% / 15.05.2027	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,78	Frankreich
STMICROELECTRONICS NV / 04.08.2027	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,61	Schweiz
DUKE ENERGY CORP / 4,125% / 15.04.2026	D. Energieversorgung	2,60	USA
PIONEER NAT RES CO / 0,250% / 15.05.2025	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,48	USA
WORLDLINE SA / 30.07.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,40	Frankreich
LENOVO GROUP LTD / 2,500% / 26.08.2029	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,25	China
SOUTHERN COMPANY (THE) / 3,875% / 15.12.2025	D. Energieversorgung	2,18	USA
BOOKING HOLDINGS INC / 0,750% / 01.05.2025	N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,03	USA
LG CHEM LTD / 1,250% / 18.07.2028	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,01	Südkorea, Republik
CMS ENERGY CORP / 3,375% / 01.05.2028	D. Energieversorgung	1,89	USA

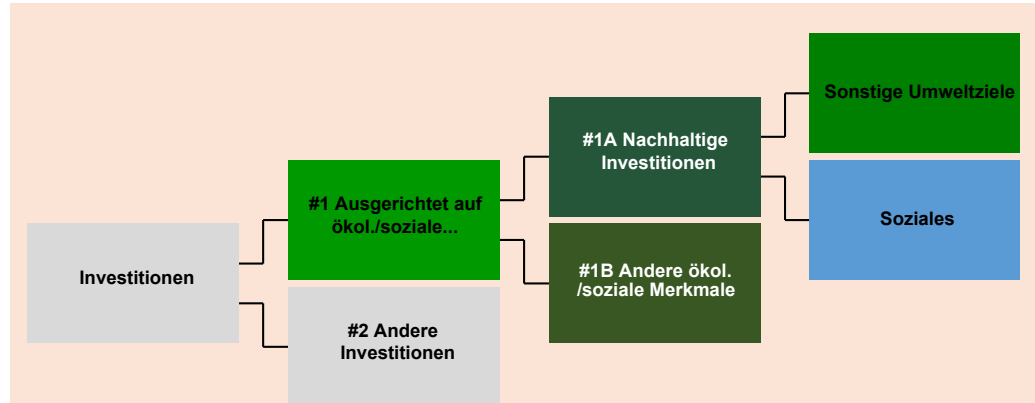
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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?**



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 95,46% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 28,21% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 67,25% seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 4,54% seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. 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	5,10%
C. Verarbeitendes Gewerbe	31,25%
D. Energieversorgung	9,54%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	1,16%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,71%
H. Verkehr und Lagerei	4,09%
I. Gastgewerbe	0,23%
J. Information und Kommunikation	11,64%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	18,19%

L. Grundstücks- und Wohnungswesen	4,95%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	2,68%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,91%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,24%
Andere	4,31%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 Teilssektoren 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	4,18%
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	3,23%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	1,88%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

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

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

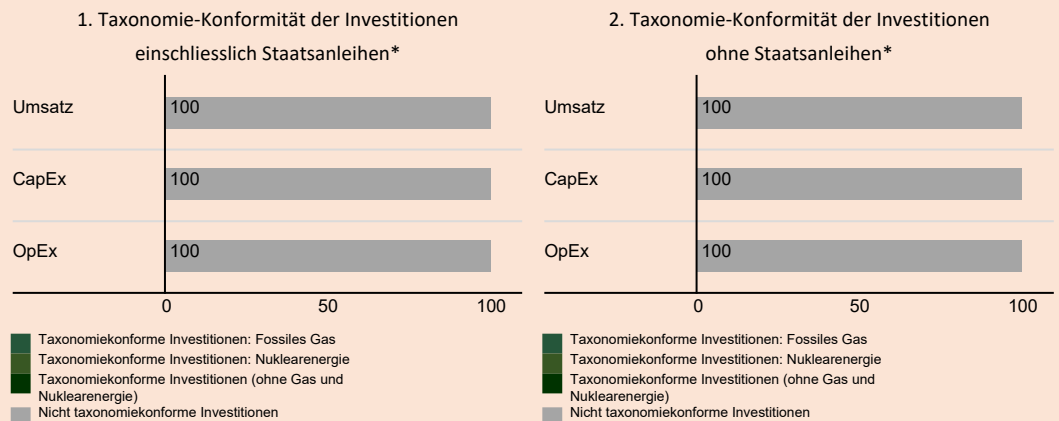
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 23,88% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 waren 4,34% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.10.2023 waren 4,54% 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 führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, leiten die Anlageverwalter ein ESG-bereinigtes fundamentales Wandelanleihen-Rating für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds ab, indem sie eine eigene Methode anwenden, um das fundamentale Wandelanleihen-Rating des Emittenten (basierend auf einem quantitativen Multifaktormodell für Wandelanleihen) systematisch mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes fundamentales Wandelanleihen-Rating abzuleiten. Das ESG-bereinigte fundamentale Wandelanleihen-Rating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung einen Vergleich von Wertpapieren auf ESG-bereinigter Basis und eine Beurteilung dessen, ob bestimmte Wertpapiere zum Portfolio hinzugefügt oder im Portfolio gehalten werden sollten. Die ESG-bereinigten fundamentalen Wandelanleihen-Ratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des fundamentalen Wandelanleihen-Ratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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) Financial Bond Fund **Rechtsträgerkennung (LEI):** 549300J3GFD3B1413R61

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit einem Umweltziel <input type="checkbox"/> getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 12,44% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p>

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 14,95%, AA: 55,07%, A: 20,80%, BBB: 3,33%, BB: 0,00%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,68%, Keine Datenabdeckung**: 1,15%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	8,22	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,78	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,11	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 32,03%, Gelb: 33,67%, Orange: 28,46%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,68%, Keine Datenabdeckung**: 1,15%	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: 71,18%, Neutral: 24,29%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 4,53%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	---	--

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

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

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

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 12,27%, AA: 53,78%, A: 20,23%, BBB: 6,36%, BB: 0,00%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,66%, Keine Datenabdeckung**: 2,70%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,95	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,91	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,41	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 35,69%, Gelb: 30,32%, Orange: 26,63%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,66%, Keine Datenabdeckung**: 2,70%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 68,75%, Neutral: 28,53%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 2,72%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

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

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 Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	52,63	95,76	78,94
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	139,30	95,76	78,94
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	23.734,19	95,76	78,66
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	23.927,38	95,76	78,66
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	57,18	95,76	78,66
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	525,89	95,76	93,52
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	0,74	95,76	93,79
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	41,81	95,76	82,60
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14

6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,76	87,14
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	95,76	93,79
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	95,76	0,00
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	95,76	9,80
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	95,76	93,79
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	16,56	95,76	93,79
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	9,69	95,76	38,23
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	38,46	95,76	93,79
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	95,76	93,79
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	0,00	0,00	0,00
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	0,00	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	0,00	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
BARCLAYS PLC / 7,125% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,66	Vereinigtes Königreich
LLOYDS BANKING GROUP PLC / 7,875% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,51	Vereinigtes Königreich
ING GROEP NV / 5,750% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,37	Niederlande
COMMERZBANK AG / 6,125% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,35	Deutschland
CREDIT AGRICOLE SA / 7,500% / 31. Dezember 2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,34	Frankreich
ABN AMRO BANK NV / 4,750% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,33	Niederlande
HSBC HOLDINGS PLC / 4,750% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,32	Vereinigtes Königreich
COOPERATIEVE RABOBANK UA / 4,375% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,21	Niederlande
BNP PARIBAS SA / 7,375% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,15	Frankreich
NATWEST GROUP PLC / 5,125% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,06	Vereinigtes Königreich
SVENSKA HANDELSBANKEN AB / 4,750% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,05	Schweden
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY / 5,875% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,05	Vereinigtes Königreich
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA / 6,000% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,04	Spanien
UNICREDIT SPA / 5,375% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,00	Italien
NYKREDIT REALKREDIT A/S / 4,125% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,99	Dänemark

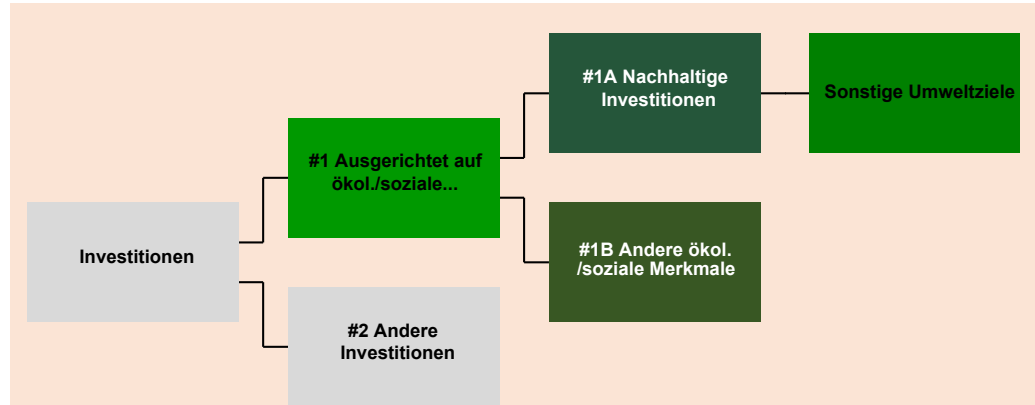
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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?**



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 95,32% seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 12,44% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 82,88% seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 4,68% seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	94,32%
Andere	5,68%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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.

Subfondsenengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

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

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

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

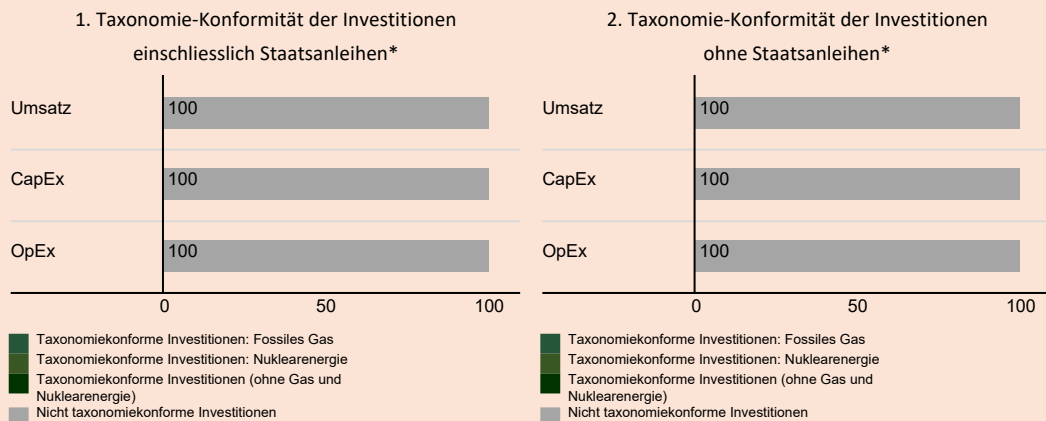
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich 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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 12,44% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 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 31.10.2023 waren 4,68% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

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

- ESG-Wertpapieranalyse

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, berechneten die Anlageverwalter eine ESG-bereinigte Kreditansicht für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds, indem sie eine eigene Methode anwendeten, um

systematisch das traditionelle Kreditrating des Emittenten mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes Kreditrating abzuleiten. Das ESG-bereinigte Kreditrating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung einen Vergleich von Wertpapieren auf ESG-bereinigter Basis und eine Beurteilung dessen, ob bestimmte Wertpapiere zum Portfolio hinzugefügt oder im Portfolio gehalten werden sollten. Die ESG-bereinigten Kreditratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des zugrunde liegenden traditionellen Kreditratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) SQ Euro Corporate Bond Fund
 Rechtsträgerkennung (LEI): 4MUZMYBK2EDYUP28678

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,61% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).
 Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.
 Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 14,59%, AA: 44,32%, A: 26,13%, BBB: 9,49%, BB: 2,15%, B: 1,43%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,51%, Keine Datenabdeckung**: 1,39%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,46	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,97	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,59	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 16,40%, Gelb: 36,13%, Orange: 42,13%, Rot: 1,43%, Nicht bewertbar**: 3,14%, Keine Datenabdeckung**: 0,77%	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: 59,68%, Neutral: 38,39%, Negativ: 1,43%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 0,51%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 14,28%, AA: 40,78%, A: 25,01%, BBB: 11,00%, BB: 3,32%, B: 3,04%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,66%, Keine Datenabdeckung**: 1,92%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,17	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,18	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,87	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 23,61%, Gelb: 31,46%, Orange: 39,45%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 3,57%, Keine Datenabdeckung**: 1,92%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).

Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 55,51%, Neutral: 40,79%, Negativ: 3,04%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 0,66%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	---	--

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

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem 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).

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde 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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	12.860,31	95,94	91,97
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1.820,59	95,94	91,97
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	91.339,26	95,94	91,97
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	105.594,49	95,94	91,90
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	473,29	95,94	91,90
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	835,11	95,94	94,22
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	12,39	95,94	94,38
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	49,80	95,94	83,34

6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,94	86,90
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,94	86,90
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,04	95,94	86,90
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,12	95,94	86,90
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	95,94	86,90
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,94	86,90
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,94	86,90
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	95,94	86,90
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	95,94	86,90
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,95	95,94	94,38
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,48	95,94	2,92
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,49	95,94	33,08
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	1,50	95,94	95,13
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)	21,81	95,94	94,38
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	6,99	95,94	38,51
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	35,89	95,94	94,38
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	95,94	94,38
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	6,80	3,09	3,09
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	3,09	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	3,09	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			

18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
---	-------	------	------

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) / 2,300% / 15.02.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,67	Deutschland
JPMORGAN CHASE & CO / 1,963% / 23.03.2030	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,34	Vereinigte Staaten von Amerika
MOLSON COORS BEVERAGE CO / 1,250% / 15.07.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,26	Vereinigte Staaten von Amerika
SOCIETE GENERALE SA / 1,125% / 23.01.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,24	Frankreich
UBS GROUP AG / 2,750% / 15.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,23	Schweiz
MORGAN STANLEY / 2,950% / 07.05.2032	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,15	Vereinigte Staaten von Amerika
CREDIT AGRICOLE SA / 0,375% / 20.04.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,08	Frankreich
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP / 1,750% / 07.03.2028	J. Information und Kommunikation	0,99	Vereinigte Staaten von Amerika
ORANGE SA / 04.09.2026	J. Information und Kommunikation	0,96	Frankreich
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) / 15.02.2032	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,96	Deutschland
BANK OF AMERICA CORP / 2,824% / 27.04.2033	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,95	Vereinigte Staaten von Amerika
CITIGROUP INC / 1,250% / 10.04.2029	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,92	Vereinigte Staaten von Amerika
BNP PARIBAS SA / 2,100% / 07.04.2032	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,89	Frankreich
CARLSBERG BREWERIES A/S / 0,625% / 09.03.2030	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,87	Dänemark
COOPERATIEVE RABOBANK UA / 4,233% / 25.04.2029	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,87	Niederlande

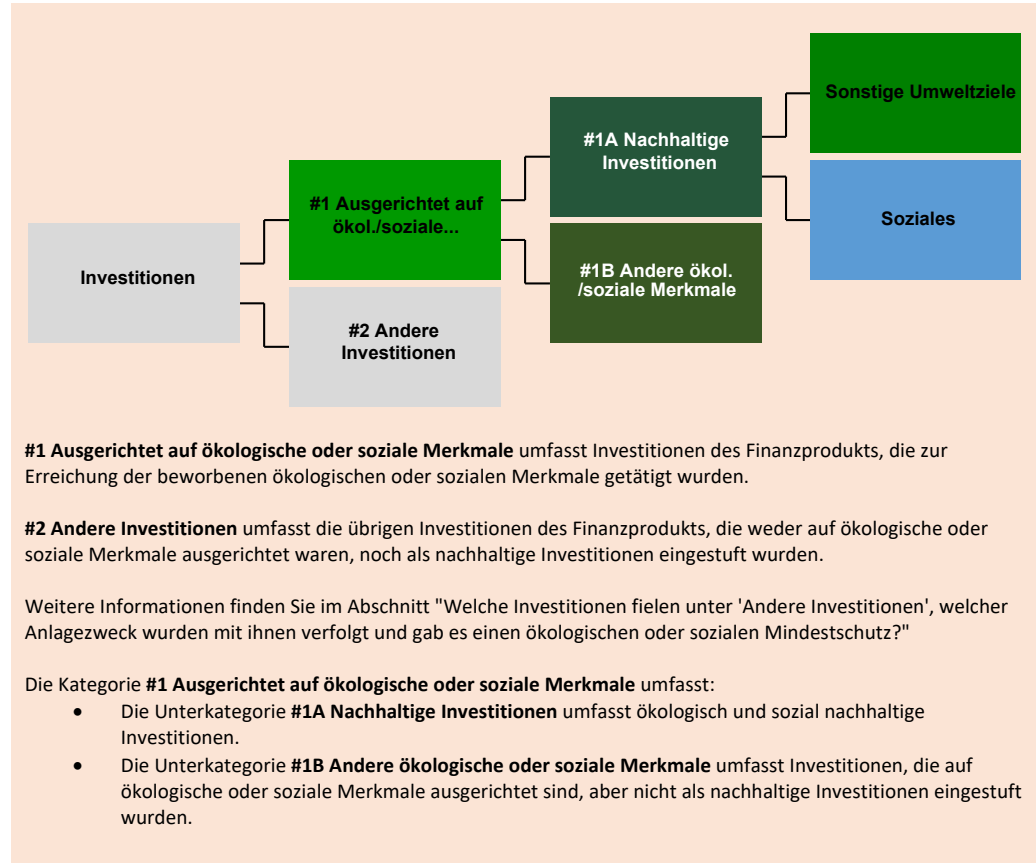
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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 99,49% seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 24,61% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 74,89% seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 0,51% seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. 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	0,26%
C. Verarbeitendes Gewerbe	16,01%
D. Energieversorgung	4,65%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,61%
H. Verkehr und Lagerei	0,75%
I. Gastgewerbe	0,38%
J. Information und Kommunikation	7,09%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	67,13%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,63%
Andere	0,51%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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	0,26%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,97%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,90%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

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

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

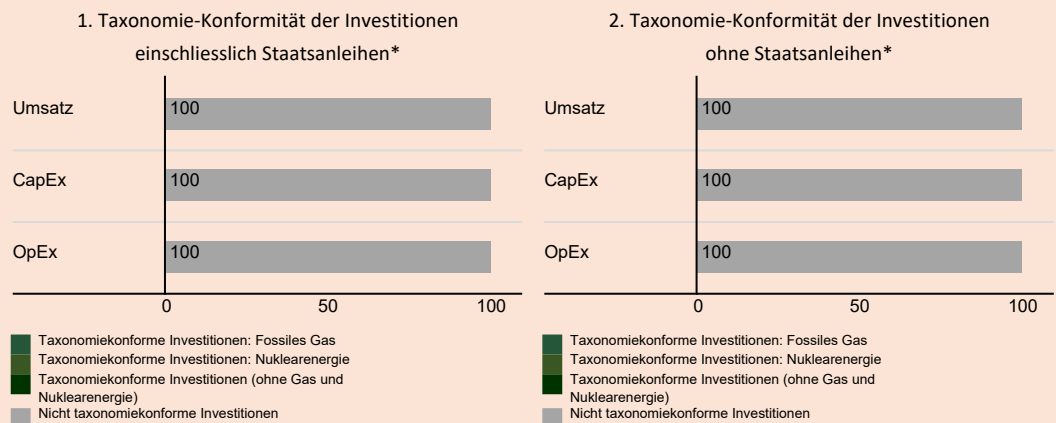
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 21,99% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 waren 2,62% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.10.2023 waren 0,51% 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 verstiessten wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

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

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

Keine Angaben

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

- **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) Global Inflation Linked Bond Fund
Rechtsträgerkennung (LEI): 6NH5N4J6GL7FWYEB3F23

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

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

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

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



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

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

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).
 Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.
 Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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

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. Für den Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis 31.10.2023 hielt dieser Subfonds keine zugrunde liegenden Vermögenswerte, die Gegenstand von Engagementaktivitäten von CSAM waren. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.

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

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 0,00%, AA: 9,60%, A: 79,70%, BBB: 7,02%, BB: 0,65%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 2,27%, Keine Datenabdeckung**: 0,76%	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	5,23	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	6,66	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,05	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 2,95%, Gelb: 2,04%, Orange: 7,36%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 87,65%, Keine Datenabdeckung**: 0,00%	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: 9,60%, Neutral: 87,98%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,76%, Keine Datenabdeckung**: 1,66%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 0,79%, AA: 6,97%, A: 79,16%, BBB: 8,73%, BB: 0,39%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 3,51%, Keine Datenabdeckung**: 0,45%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	5,51	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	7,19	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,11	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 1,26%, Gelb: 4,41%, Orange: 6,49%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 87,39%, Keine Datenabdeckung**: 0,45%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 7,76%, Neutral: 89,53%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,45%, Keine Datenabdeckung**: 2,25%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

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

Der Subfonds tätigte keine nachhaltigen Investitionen.

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

Der Subfonds tätigte keine nachhaltigen Investitionen.

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?**

Der Subfonds tätigte keine nachhaltigen Investitionen.

— — **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:**

Der Subfonds tätigte keine nachhaltigen Investitionen.

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

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

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



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

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen PAI aus der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission. Die Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen werden als nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	52,24	13,01	11,19
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	87,25	13,01	11,19
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	3.036,89	13,01	11,19
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	3.178,05	13,01	11,19
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	8,11	13,01	11,19
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	48,44	13,01	11,91
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	0,00	13,01	13,01
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	7,50	13,01	11,43
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82

6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	13,01	11,82
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	13,01	13,01
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	13,01	0,13
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,00	13,01	0,67
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	13,01	13,01
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)	7,08	13,01	13,01
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	0,51	13,01	2,90
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	4,49	13,01	12,09
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	13,01	13,01
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	226,58	86,34	85,72
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	86,34	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	86,34	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
UNITED STATES TREASURY / 0,125% / 15.01.2032	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	4,95	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,125% / 15.07.2031	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,79	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 1,125% / 15.01.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,79	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,875% / 15.01.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,43	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,125% / 15.01.2030	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,29	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,375% / 15.07.2027	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,12	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,250% / 15.07.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,79	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 1,250% / 15.04.2028	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,77	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 3,625% / 15.04.2028	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,70	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,750% / 15.07.2028	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,64	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,375% / 15.01.2027	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,59	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,125% / 15.10.2026	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,49	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,625% / 15.07.2032	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,30	Vereinigte Staaten von Amerika
JAPAN (GOVERNMENT OF) / 0,100% / 10.03.2025	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,15	Japan
UNITED STATES TREASURY / 0,125% / 15.07.2030	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,09	Vereinigte Staaten von Amerika

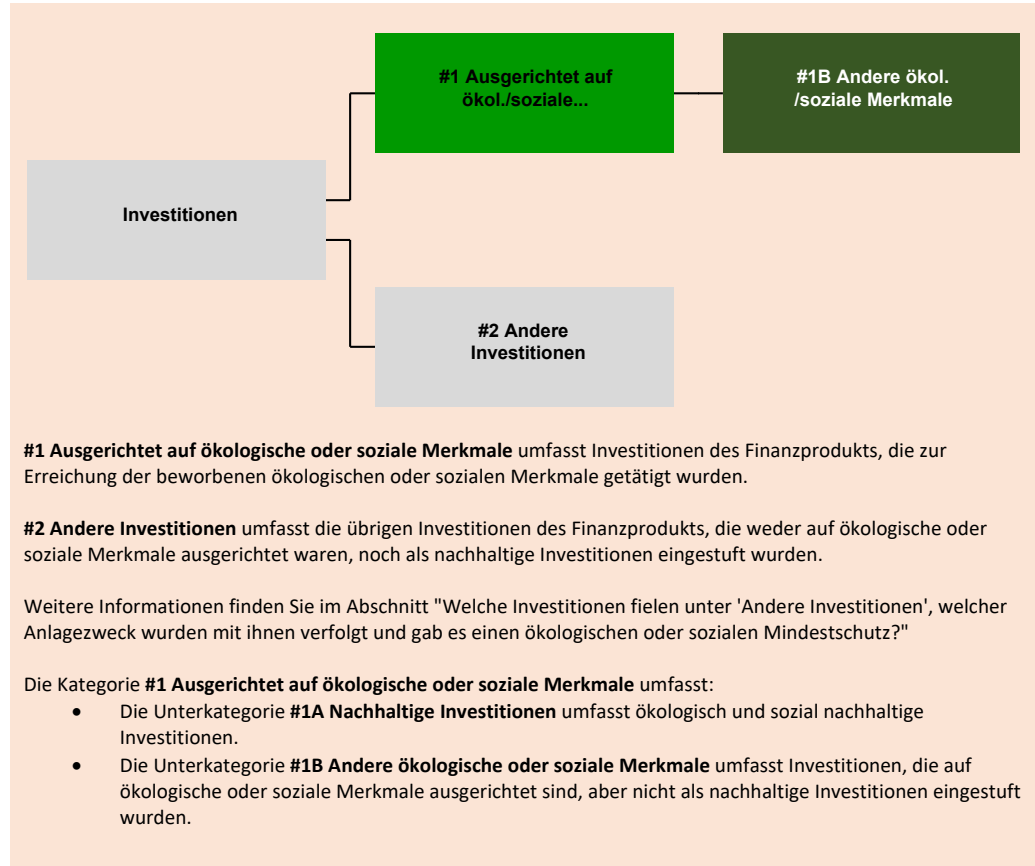
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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 96,97% seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 0,00% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 96,97% seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 3,03% seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	0,33%
J. Information und Kommunikation	1,46%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	10,09%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	85,38%
Andere	2,74%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

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

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

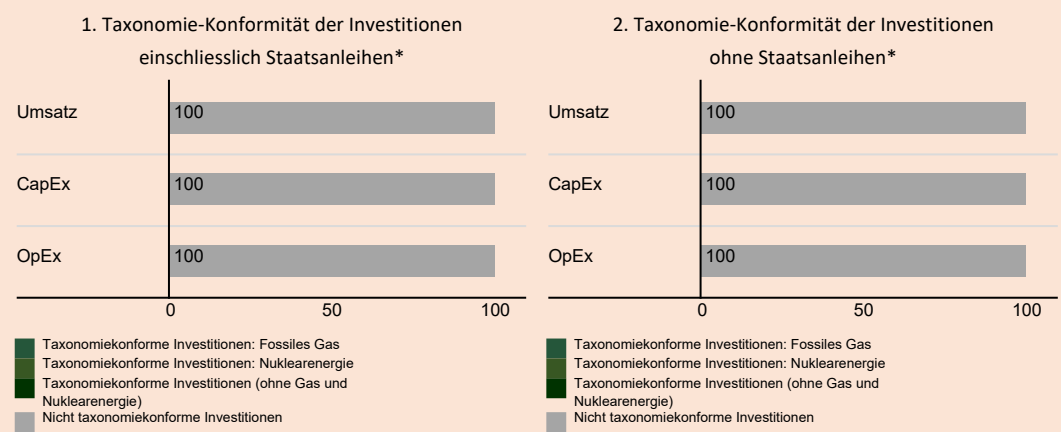
¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche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

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 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 31.10.2023 waren 3,03% 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 verstieszen 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

Für den Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis 31.10.2023 hielt dieser Subfonds keine zugrunde liegenden Vermögenswerte, die Gegenstand von Engagementaktivitäten waren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Floating Rate Credit Fund
Rechtsträgerkennung (LEI): RXN40DS7SNSLC5FIRJ39

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 12,90% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).
 Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.
 Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 4,69%, AA: 25,55%, A: 27,74%, BBB: 19,57%, BB: 8,54%, B: 2,18%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 3,06%, Keine Datenabdeckung**: 8,68%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,18	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,52	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,43	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 21,16%, Gelb: 24,86%, Orange: 34,78%, Rot: 0,80%, Nicht bewertbar**: 13,55%, Keine Datenabdeckung**: 4,86%	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: 32,03%, Neutral: 56,46%, Negativ: 2,18%, Nicht bewertbar**: 2,27%, Keine Datenabdeckung**: 7,06%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 6,88%, AA: 20,66%, A: 21,64%, BBB: 16,63%, BB: 13,93%, B: 5,22%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 2,27%, Keine Datenabdeckung**: 12,79%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	5,72	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,75	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,52	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 26,14%, Gelb: 18,45%, Orange: 26,97%, Rot: 0,68%, Nicht bewertbar**: 14,75%, Keine Datenabdeckung**: 13,01%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 22,84%, Neutral: 61,12%, Negativ: 5,22%, Nicht bewertbar**: 4,98%, Keine Datenabdeckung**: 5,84%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

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

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, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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.

— — — 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:

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.

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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	29.753,70	94,64	80,47
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	9.106,19	94,64	80,47
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	167.824,86	94,64	80,47
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	206.083,30	94,64	80,47
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	546,83	94,64	80,47
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	1.025,71	94,64	87,78
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	8,97	94,64	85,38
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	46,67	94,64	71,80
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,64	75,11

6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,07	94,64	75,11
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,15	94,64	75,11
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	94,64	75,11
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,64	75,11
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,64	75,11
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,64	75,11
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,64	75,11
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,64	75,11
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,58	94,64	85,78
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	7,47	94,64	1,92
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	17,36	94,64	30,03
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,80	94,64	87,95
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)	24,82	94,64	84,56
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	5,28	94,64	26,99
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	29,64	94,64	85,32
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	94,64	85,38
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	3,19	2,34	1,52
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	2,34	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	2,34	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			

18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
---	-------	------	------

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
UNITED STATES TREASURY / 3,875% / 15.08.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	4,22	Vereinigte Staaten von Amerika
SUMITOMO BENELUX SA	Andere	2,80	Belgien
QATAR NATIONAL BANK (QPSC) (LONDON)	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,53	Katar
BPCE SA / 6,612% / 19.10.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,42	Frankreich
WARNERMEDIA HOLDINGS INC / 3,788% / 15.03.2025	J. Information und Kommunikation	1,38	Vereinigte Staaten von Amerika
T-MOBILE USA INC / 3,750% / 15.04.2027	J. Information und Kommunikation	1,19	Deutschland
BOOKING HOLDINGS INC / 1,800% / 03.03.2027	N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,14	Vereinigte Staaten von Amerika
NATWEST GROUP PLC / 7,472% / 10.11.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,14	Vereinigtes Königreich
SWEDBANK AB / 6,136% / 12.09.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,14	Schweden
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA / 5,862% / 14.09.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,13	Spanien
BARCLAYS PLC / 5,304% / 09.08.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,12	Vereinigtes Königreich
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA / 1,125% / 12.02.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,10	Portugal
SIGMA ALIMENTOS SA DE CV / 4,125% / 02.05.2026	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,09	Mexiko
FREEPORT INDONESIA PT / 4,763% / 14.04.2027	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,08	Indonesien
RCI BANQUE / 4,875% / 14.06.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,07	Frankreich

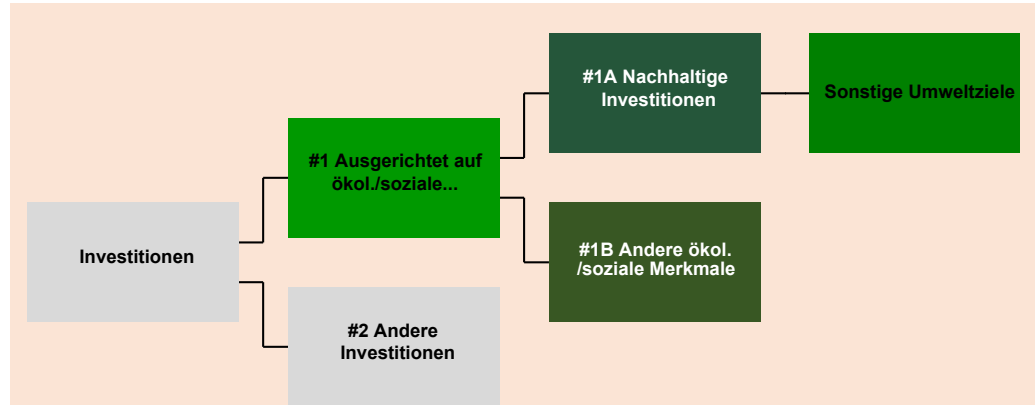
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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?**



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 91,12% seines Gesamtnettovermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 12,90% seines Gesamtnettovermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 78,21% seines Gesamtnettovermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 8,88% seines Gesamtnettovermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. 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	4,54%
C. Verarbeitendes Gewerbe	11,66%
D. Energieversorgung	0,86%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,59%
J. Information und Kommunikation	4,87%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	64,28%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,14%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	4,22%
Andere	6,84%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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	0,83%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,00%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,00%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

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

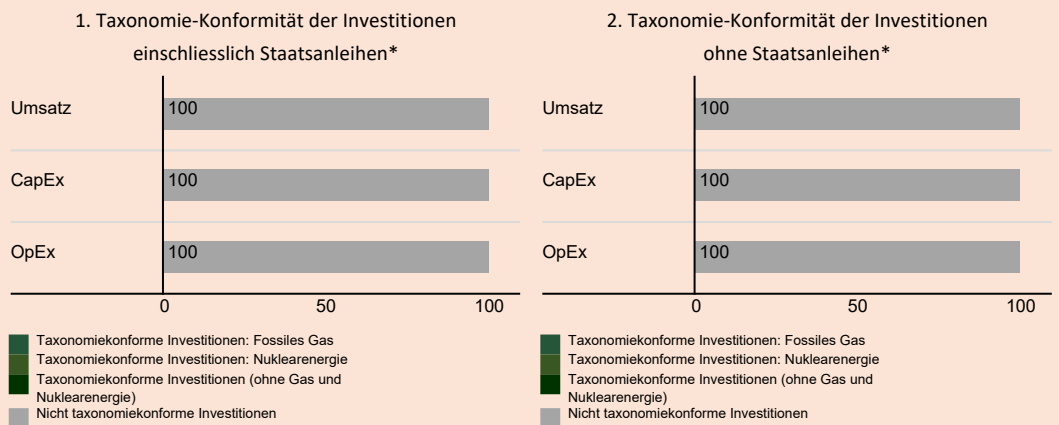
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 12,90% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 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 31.10.2023 waren 8,88% 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.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

Keine Angaben

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Global Value Bond Fund
 Rechtsträgerkennung (LEI): 6ER10RSZ2Y5KE8QP3Q46

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 14,44% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).
 Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.
 Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 2,67%, AA: 15,73%, A: 61,44%, BBB: 4,89%, BB: 5,91%, B: 1,83%, CCC: 0,17%, Nicht bewertbar**: 3,07%, Keine Datenabdeckung**: 4,30%	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	5,81	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,55	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,49	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 18,45%, Gelb: 12,32%, Orange: 18,95%, Rot: 1,12%, Nicht bewertbar**: 45,23%, Keine Datenabdeckung**: 3,94%	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: 18,28%, Neutral: 74,91%, Negativ: 1,96%, Nicht bewertbar**: 1,50%, Keine Datenabdeckung**: 3,34%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 3,81%, AA: 18,50%, A: 46,87%, BBB: 1,67%, BB: 4,83%, B: 4,81%, CCC: 1,46%, Nicht bewertbar**: 2,89%, Keine Datenabdeckung**: 15,16%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	5,77	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,7	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,68	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 15,33%, Gelb: 10,24%, Orange: 19,81%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 40,00%, Keine Datenabdeckung**: 14,63%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).

Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 24,24%, Neutral: 63,03%, Negativ: 7,65%, Nicht bewertbar** : 0,80%, Keine Datenabdeckung** : 4,27%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	---	--

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

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

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

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

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, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, 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 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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	3.194,69	58,49	47,21
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	749,21	58,49	47,21
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	11.329,67	58,49	47,16
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	15.271,78	58,49	47,13
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	338,62	58,49	47,13
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	580,62	58,49	52,91
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	2,83	58,49	53,19
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	25,51	58,49	40,34
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	58,49	43,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	58,49	43,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,08	58,49	43,00
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,09	58,49	43,00
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	58,49	43,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	58,49	43,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	58,49	43,00
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	58,49	43,00
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	58,49	43,00
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,22	58,49	53,39
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	7,87	58,49	2,50
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1.165,63	58,49	18,00
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	1,26	58,49	53,67
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)	21,13	58,49	53,13

12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,93	58,49	16,41
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	16,62	58,49	52,40
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	58,49	53,19
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	114,32	38,87	38,23
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	38,87	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	38,87	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögen swerte	Land
UNITED STATES TREASURY / 1,750% / 31.07.2024	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	11,95	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,375% / 30.04.2025	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	11,38	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,750% / 31.03.2026	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	11,09	Vereinigte Staaten von Amerika
NESTLE HLDGS INC. / 0,625% / 15.01.2026	C. Verarbeitendes Gewerbe	3,31	Schweiz
BANK OF AMERICA CORP / 2,456% / 22.10.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,35	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 4,125% / 15.11.2032	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,35	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 3,375% / 15.05.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,20	Vereinigte Staaten von Amerika
ING GROEP NV / 1,726% / 01.04.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,19	Niederlande
ENI SPA / 2,950% / 14.09.2030	D. Energieversorgung	2,19	Italien
JPMORGAN CHASE & CO / 1,040% / 04.02.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,18	Vereinigte Staaten von Amerika

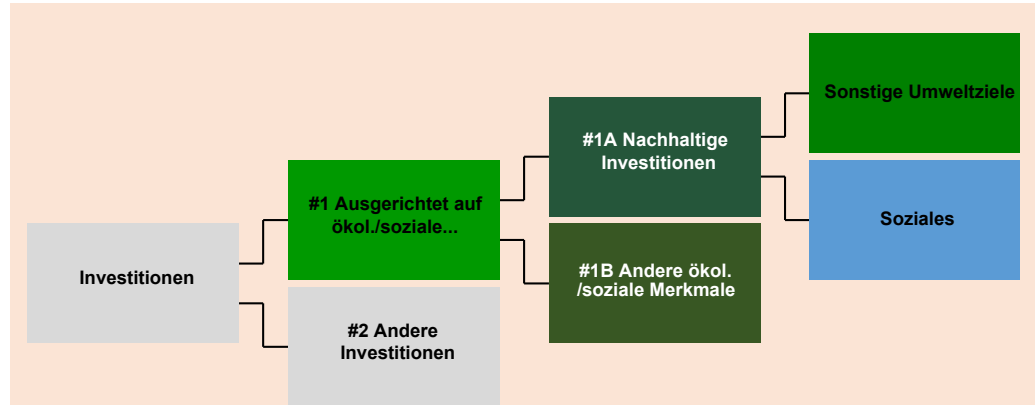
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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?**



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 95,72% seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 14,44% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 81,28% seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 4,28% seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,01%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,96%
C. Verarbeitendes Gewerbe	9,31%
D. Energieversorgung	3,83%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,02%
F. Baugewerbe	0,06%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,41%
H. Verkehr und Lagerei	0,49%
I. Gastgewerbe	0,07%

J. Information und Kommunikation	4,21%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	30,20%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	2,63%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,75%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,14%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	40,86%
P. Bildung	0,02%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,97%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,15%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,03%
Andere	3,87%

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

*** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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	0,22%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,01%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,03%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	2,23%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,00%

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

*** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

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

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

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.



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

Zum 31.10.2023 meldete der Subfonds ein Engagement von 0,00% in nachhaltigen Anlagen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel.

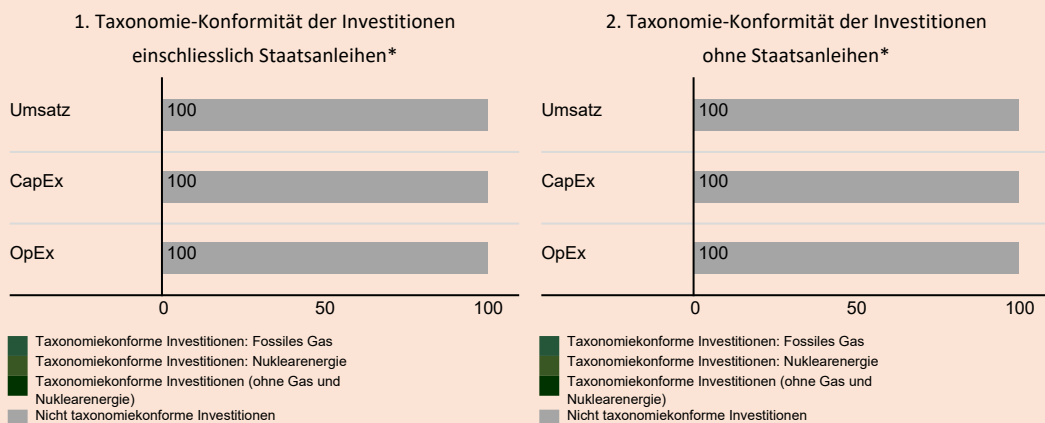
● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹?

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

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.

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

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

Von den 0,00% der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 12,70% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 waren 1,74% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.10.2023 waren 4,28% 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 verstiesen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

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

- ESG-Wertpapieranalyse

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, berechneten die Anlageverwalter eine ESG-bereinigte Kreditansicht für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds, indem sie eine eigene Methode anwendeten, um systematisch das traditionelle Kreditrating des Emittenten mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes Kreditrating abzuleiten. Das ESG-bereinigte Kreditrating ermöglichte den Anlageverwaltern während der Phase der 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-bereinigtes Kreditratings mit etablierten Instrumenten traditioneller Anlagestrategien, um fundiertere Anlageentscheidungen treffen zu können.

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) SQ US Corporate Bond Fund
 Rechtsträgerkennung (LEI): 54930002CVO1HNJBSO68

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 13,35% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).
 Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.
 Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 6,95%, AA: 38,12%, A: 35,47%, BBB: 13,58%, BB: 4,28%, B: 0,61%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,80%, Keine Datenabdeckung**: 0,18%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,87	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,46	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 19,16%, Gelb: 27,89%, Orange: 47,69%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 5,08%, Keine Datenabdeckung**: 0,18%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).

Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 45,07%, Neutral: 53,51%, Negativ: 0,61%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 0,80%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	---	--

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 5,71%, AA: 26,41%, A: 38,57%, BBB: 14,70%, BB: 11,56%, B: 0,81%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 1,09%, Keine Datenabdeckung**: 1,15%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,54	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,01	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,75	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 28,81%, Gelb: 26,83%, Orange: 33,38%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 9,58%, Keine Datenabdeckung**: 1,40%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 32,12%, Neutral: 65,28%, Negativ: 1,25%, Nicht bewertbar**: 0,27%, Keine Datenabdeckung**: 1,09%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgten (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde 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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	17.567,42	96,27	92,43
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	3.835,88	96,27	92,43
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	150.713,52	96,27	92,43
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	171.682,94	96,27	92,43
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	356,28	96,27	92,43
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	789,90	96,27	94,83
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	8,30	96,27	94,94
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	48,94	96,27	78,17
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,27	83,18
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	96,27	83,18
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,06	96,27	83,18
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,11	96,27	83,18
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,27	83,18

6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,27	83,18
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,27	83,18
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,04	96,27	83,18
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	96,27	83,18
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,42	96,27	95,11
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,20	96,27	1,81
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,09	96,27	23,90
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	96,27	95,39
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)	48,85	96,27	94,68
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	6,34	96,27	27,81
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	32,89	96,27	94,85
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	96,27	94,94
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	7,82	2,58	2,58
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	2,58	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	2,58	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
JPMORGAN CHASE & CO / 1,470% / 22.09.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,47	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 3,500% / 15.02.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,33	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 3,875% / 15.08.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,21	Vereinigte Staaten von Amerika
BANK OF AMERICA CORP / 5,015% / 22.07.2033	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,15	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 3,375% / 15.05.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,14	Vereinigte Staaten von Amerika
BPCE SA / 6,612% / 19.10.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,05	Frankreich
JPMORGAN CHASE & CO / 2,947% / 24.02.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,95	Vereinigte Staaten von Amerika
BP CAPITAL MARKETS PLC / 4,375% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,94	Vereinigtes Königreich
BANK OF AMERICA CORP / 1,319% / 19.06.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,92	Vereinigte Staaten von Amerika
AMAZON.COM INC / 3,600% / 13.04.2032	G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,92	Vereinigte Staaten von Amerika
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO / 5,250% / 01.07.2028	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,83	Vereinigte Staaten von Amerika
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE / 1,542% / 10.09.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,83	Vereinigte Staaten von Amerika
BNP PARIBAS SA / 4,375% / 28.09.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,81	Frankreich
MORGAN STANLEY / 3,622% / 01.04.2031	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,81	Vereinigte Staaten von Amerika
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC / 2,651% / 22.05.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,81	Japan

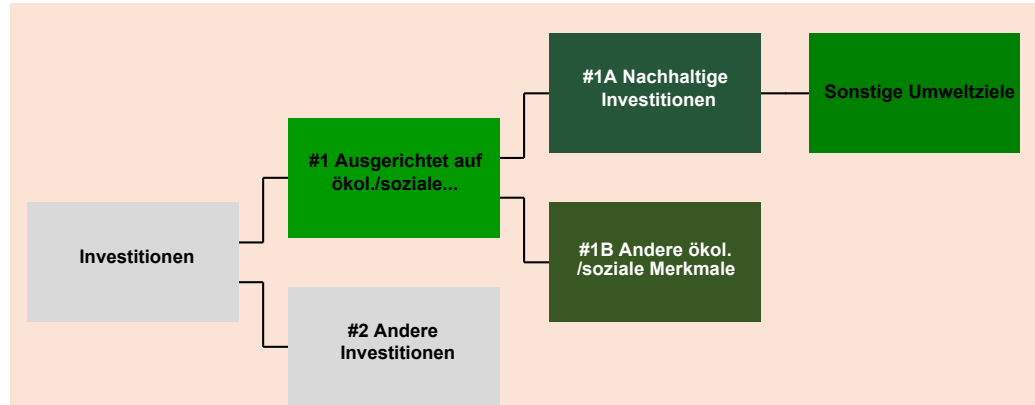
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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?**



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 99,20% seines Gesamtnettovermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 13,35% seines Gesamtnettovermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 85,85% seines Gesamtnettovermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 0,80% seines Gesamtnettovermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. 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	2,19%
C. Verarbeitendes Gewerbe	15,54%
D. Energieversorgung	0,94%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	6,35%
H. Verkehr und Lagerei	2,39%
I. Gastgewerbe	0,54%
J. Information und Kommunikation	9,31%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	53,52%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	1,47%

M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,71%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,68%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	1,56%
Andere	0,80%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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	1,43%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,21%
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 Mineralölerzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

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

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

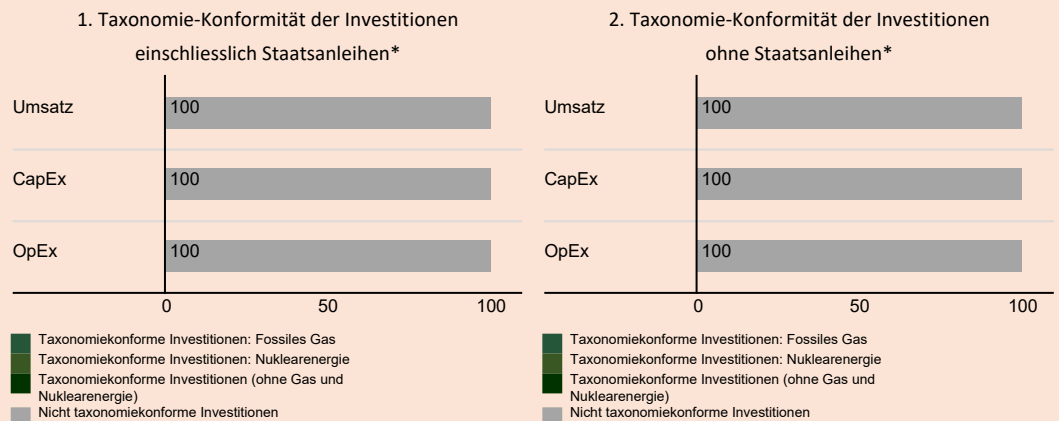
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 13,35% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 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 31.10.2023 waren 0,80% 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 verstiessten wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

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

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

Keine Angaben

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Latin America Corporate Bond Fund
 Rechtsträgerkennung (LEI): 549300RFIZDOZW01UJ83

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,37% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

Dieser Subfonds bewirbt Merkmale aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) (im Sinne von Art. 8 der Verordnung (EU) 2019/2088).
 Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet.
 Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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

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. Für den Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis 31.10.2023 hielt dieser Subfonds keine zugrunde liegenden Vermögenswerte, die Gegenstand von Engagementaktivitäten von CSAM waren. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.

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

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 0,00%, AA: 10,47%, A: 18,90%, BBB: 28,71%, BB: 14,16%, B: 4,82%, CCC: 1,98%, Nicht bewertbar**: -0,03%, Keine Datenabdeckung**: 20,98%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	4,88	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,33	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	4,38	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 46,44%, Gelb: 12,23%, Orange: 18,20%, Rot: 0,59%, Nicht bewertbar**: 2,38%, Keine Datenabdeckung**: 20,15%	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: 13,21%, Neutral: 78,54%, Negativ: 4,92%, Nicht bewertbar**: 1,33%, Keine Datenabdeckung**: 1,99%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 0,59%, AA: 9,85%, A: 17,64%, BBB: 16,77%, BB: 16,69%, B: 15,73%, CCC: 1,31%, Nicht bewertbar**: 0,00%, Keine Datenabdeckung**: 21,41%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	4,65	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,28	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	4,10	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 51,66%, Gelb: 9,46%, Orange: 16,58%, Rot: 0,40%, Nicht bewertbar**: 0,49%, Keine Datenabdeckung**: 21,41%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 12,23%, Neutral: 64,90%, Negativ: 18,80%, Nicht bewertbar**: 4,07%, Keine Datenabdeckung**: 0,00%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

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

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, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, 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 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.

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde 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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	46.904,11	96,92	72,74
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	5.244,87	96,92	72,74
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	212.797,09	96,92	72,74
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	262.904,97	96,92	72,63
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	1.499,60	96,92	72,63
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	2.118,45	96,92	78,16
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	28,60	96,92	76,82
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	50,02	96,92	66,66

6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	96,92	64,92
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,14	96,92	64,92
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,56	96,92	64,92
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,55	96,92	64,92
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,92	64,92
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,92	64,92
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,05	96,92	64,92
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,92	64,92
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	96,92	64,92
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,47	96,92	77,19
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	193,67	96,92	3,73
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	645,88	96,92	42,02
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,63	96,92	76,82
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	16,03	96,92	76,74
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	0,64	96,92	5,96
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	14,76	96,92	76,64
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	96,92	76,93
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	9,48	2,42	2,42
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	2,42	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	2,42	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der vermögenswerte	Land
BANCO DE CREDITO DEL PERU / 3,250% / 30.09.2031	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,56	Peru
ECOPETROL SA / 8,875% / 13.01.2033	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,54	Kolumbien
UNITED STATES TREASURY / 18.04.2024	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,02	Vereinigte Staaten von Amerika
ECOPETROL SA / 4,625% / 02.11.2031	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,99	Kolumbien
BANCO DO BRASIL SA (CAYMAN ISLANDS BRANCH) / 6,250% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,98	Brasilien
AES PANAMA SRL / 4,375% / 31.05.2030	D. Energieversorgung	1,70	Panama
SUZANO AUSTRIA GMBH / 6,000% / 15.01.2029	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,68	Brasilien
MILLICOM INTL CELLULAR S.A. / 6,250% / 25.03.2029	J. Information und Kommunikation	1,62	Kolumbien
C&W SENIOR FINANCING DAC / 6,875% / 15.09.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,51	Irland
ITAU UNIBANCO HOLDING SA (CAYMAN ISLANDS BRANCH) / 7,721% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,37	Brasilien
AI CANDELARIA SPAIN SA / 5,750% / 15.06.2033	H. Verkehr und Lagerei	1,21	Luxemburg
ENEL CHILE SA / 4,875% / 12.06.2028	D. Energieversorgung	1,14	Chile
COLBUN SA / 3,150% / 06.03.2030	D. Energieversorgung	1,13	Chile
YPF SA / 8,500% / 28.07.2025	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,12	Argentinien
YPF SA / 6,950% / 21.07.2027	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,04	Argentinien

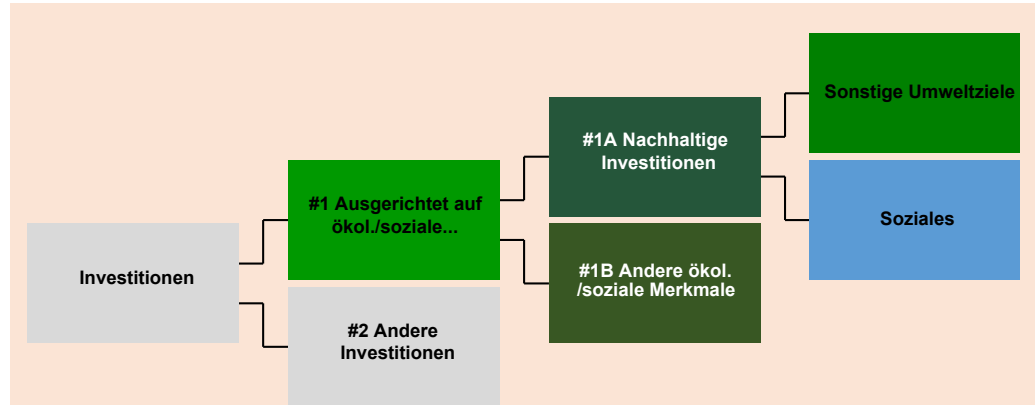
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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?**



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 97,47% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 10,37% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 87,10% seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 2,53% seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,94%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	15,61%
C. Verarbeitendes Gewerbe	17,39%
D. Energieversorgung	8,46%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,16%
H. Verkehr und Lagerei	3,34%
J. Information und Kommunikation	8,79%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	35,89%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,47%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,41%

Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,97%
Andere	2,57%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 Teilssektoren 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	10,96%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	1,18%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	3,70%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,12%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

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

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

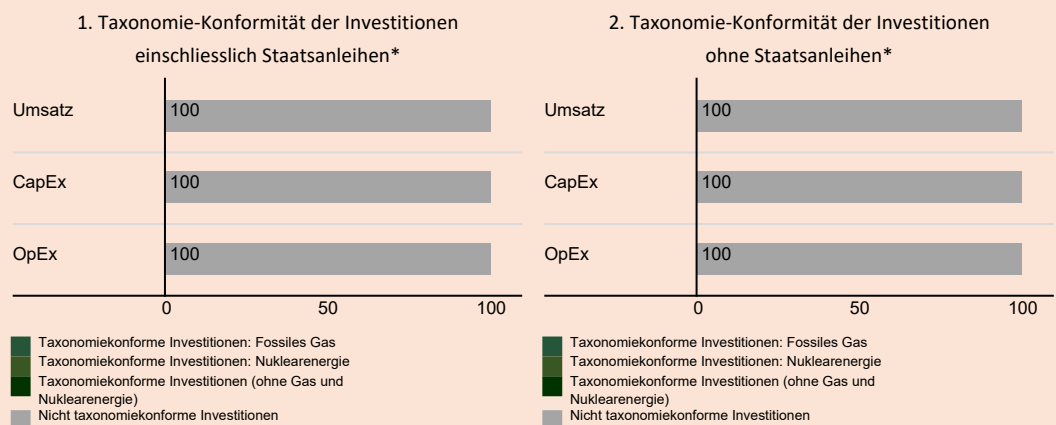
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 9,00% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 waren 1,37% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.10.2023 waren 2,53% 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

Für den Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis 31.10.2023 hielt dieser Subfonds keine zugrunde liegenden Vermögenswerte, die Gegenstand von Engagementaktivitäten waren.



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 Investment Partners (Lux) Convert International Bond Fund	Rechtsträgerkennung (LEI):	549300754VPD48PE9C37
	Heraufgestuft am 31.12.2022 von einem Artikel 6- zu einem Artikel 8-Produkt gemäss der Verordnung (EU) 2019/2088		
	Der Referenzzeitraum ist daher verkürzt auf: 31.12.2022–31.10.2023		

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.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● <input type="checkbox"/> Ja	● ● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 25,81% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



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

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

Heraufgestuft am 31.12.2022 von einem Artikel 6- zu einem Artikel 8-Produkt gemäss der Verordnung (EU) 2019/2088 Die Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates verlangt von diesem Subfonds, dass er einen SFDR-Anhang zum Jahresbericht veröffentlicht, der seiner Klassifizierung am letzten Tag des Referenzzeitraums entspricht.

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 8,10%, AA: 25,05%, A: 27,66%, BBB: 13,00%, BB: 16,67%, B: 2,62%, CCC: 1,78%, Nicht bewertbar**: 2,60%, Keine Datenabdeckung**: 2,52%	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	5,32	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,82	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,71	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 61,98%, Gelb: 22,41%, Orange: 10,05%, Rot: 0,44%, Nicht bewertbar** : 2,60%, Keine Datenabdeckung** : 2,52%	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: 32,02%, Neutral: 58,12%, Negativ: 4,03%, Nicht bewertbar** : 0,76%, Keine Datenabdeckung** : 5,07%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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?

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, 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 genehmigt.

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

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

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

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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

Investitionen dürfen:

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

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

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde 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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 31.12.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	15.695,99	94,63	92,98
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.818,78	94,63	92,98
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	56.862,31	94,63	92,50
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	75.186,07	94,63	92,18
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	509,94	94,63	92,18
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	920,62	94,63	92,10
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	9,52	94,63	92,50
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	36,32	94,63	47,95
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,63	56,21
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	94,63	56,21
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,19	94,63	56,21
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,61	94,63	56,21
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	94,63	56,21
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,63	56,21
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,63	56,21
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,19	94,63	56,21
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	94,63	56,21
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,09	94,63	92,50
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,22	94,63	1,15
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	10,29	94,63	26,35
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,40	94,63	92,50
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)	66,37	94,63	91,86
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	1,61	94,63	10,44
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	28,50	94,63	92,79
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	94,63	92,50
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	9,98	3,30	3,30
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	3,30	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	3,30	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD / 2,875% / 15.11.2023	H. Verkehr und Lagerei	1,84	USA
DUKE ENERGY CORP / 4,125% / 15.04.2026	D. Energieversorgung	1,75	USA
PALO ALTO NETWORKS INC / 0,375% / 01.06.2025	J. Information und Kommunikation	1,54	USA
ON SEMICONDUCTOR CORP / 0,500% / 01.03.2029	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,43	USA
SAFRAN SA / 01.04.2028	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,32	Frankreich
CATHAY PACIFIC FINANCE III LTD / 2,750% / 05.02.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,29	Hongkong
NIPPON STEEL CORPORATION / 05.10.2026	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,25	Japan
AMERICA MOVIL BV / 02.03.2024	J. Information und Kommunikation	1,16	Niederlande
AIRBNB INC / 15.03.2026	J. Information und Kommunikation	1,04	USA
SK HYNIX INC / 1,750% / 11.04.2030	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,03	Südkorea, Republik
RIVIAN AUTOMOTIVE INC / 3,625% / 15.10.2030	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,97	USA
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC / 3,125% / 15.01.2029	R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,93	USA
BENTLEY SYSTEMS INCORPORATED / 0,375% / 01.07.2027	J. Information und Kommunikation	0,90	USA
PIONEER NAT RES CO / 0,250% / 15.05.2025	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,90	USA
SSR MINING INC / 2,500% / 01.04.2039	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,89	Kanada

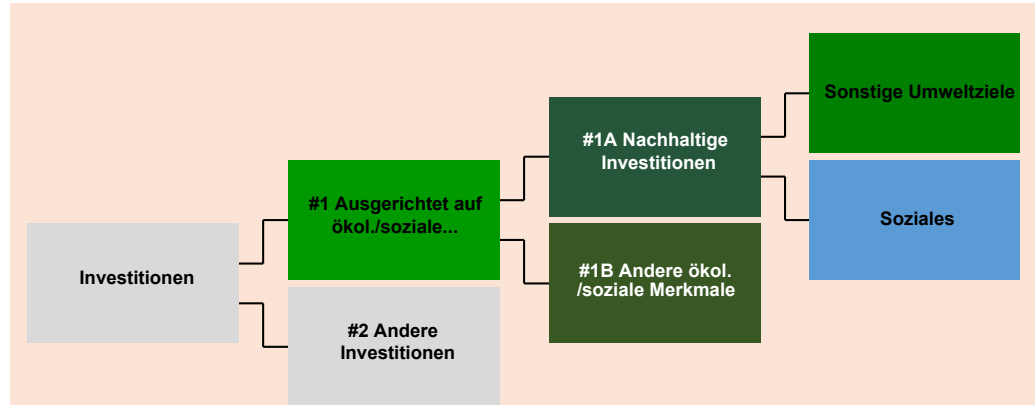
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



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?**



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 95,35% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 25,81% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 69,54% seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 4,65% seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,15%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	5,09%
C. Verarbeitendes Gewerbe	31,19%
D. Energieversorgung	5,47%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,22%
F. Baugewerbe	0,29%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,26%
H. Verkehr und Lagerei	5,08%
I. Gastgewerbe	0,76%

J. Information und Kommunikation	23,75%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	13,41%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	1,43%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	2,63%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,45%
P. Bildung	0,17%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,15%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,56%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,33%
Andere	2,60%

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

*** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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.*

Subfondsendagement in Teilspektoren 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	2,27%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,13%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,04%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	1,19%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,00%

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

*** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

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

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

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.



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

Zum 31.10.2023 meldete der Subfonds ein Engagement von 0,00% in nachhaltigen Anlagen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel.

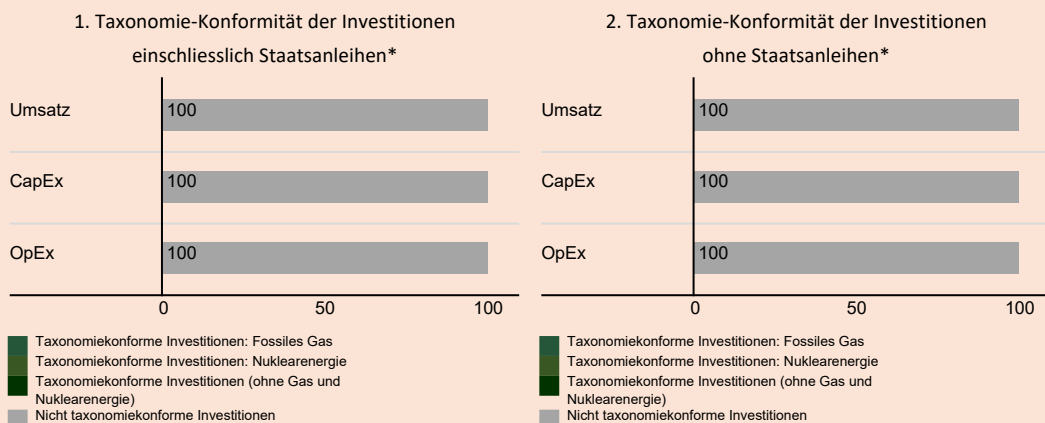
● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹?

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

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.

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

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

Von den 0,00% der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.10.2023 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 31.10.2023 waren 19,76% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 waren 6,05% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.10.2023 waren 4,65% 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 verstiesen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter führten ein Wertpapier-Research anhand der ermittelten wesentlichen ESG-Faktoren durch. Um ESG-Faktoren im Wertpapier-Research zu berücksichtigen, leiten die Anlageverwalter ein ESG-bereinigtes fundamentales Wandelanleihen-Rating für die Emittenten im Anlageuniversum des Fonds ab, indem sie eine eigene Methode anwenden, um das fundamentale Wandelanleihen-Rating des Emittenten (basierend auf einem quantitativen Multifaktormodell für Wandelanleihen) systematisch mit seinem ESG-Rating zu kombinieren und daraus ein ESG-bereinigtes fundamentales Wandelanleihen-Rating abzuleiten. Das ESG-bereinigte fundamentale Wandelanleihen-Rating 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 fundamentalen Wandelanleihen-Ratings wurden aktualisiert, sobald eine Aktualisierung des fundamentalen Wandelanleihen-Ratings oder des ESG-Ratings verfügbar war.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Die ESG-bereinigten fundamentalen Wandelanleihen-Ratings 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 fundamentalen Wandelanleihen-Ratings. In diesem Schritt kombinierten die Anlageverwalter ESG-bereinigte fundamentale Wandelanleihen-Ratings mit etablierten Instrumenten der traditionellen Anlageverwaltung, um fundiertere Anlageentscheidungen treffen zu können.

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Emerging Market Corporate Short Duration Bond Fund
Rechtsträgerkennung (LEI): 5493005Y1NXYXP8MMZ33

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, Verfahrenswesen 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.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel _____% getätigt: <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 11,38% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle), 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.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.10.2023. 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.

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 3,58%, AA: 23,99%, A: 25,74%, BBB: 14,56%, BB: 11,47%, B: 2,27%, CCC: 1,18%, Nicht bewertbar**: 1,18%, Keine Datenabdeckung**: 16,03%	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	5,11	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,45	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,06	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 44,43%, Gelb: 25,58%, Orange: 9,92%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,58%, Keine Datenabdeckung**: 13,48%	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: 29,38%, Neutral: 59,68%, Negativ: 4,04%, Nicht bewertbar**: 1,39%, Keine Datenabdeckung**: 5,52%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
---	---	--

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

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

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

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die untenstehende Tabelle enthält Daten aus früheren Bezugszeiträumen. Die Daten können von zuvor veröffentlichten Berichten abweichen, da die zuletzt verfügbaren Daten berücksichtigt wurden und einige Zahlen von dem/den Datenanbieter/n mitunter rückwirkend aktualisiert wurden. Obwohl die Nachhaltigkeitsindikatoren während der Bezugszeiträume durchgehend überwacht wurden, stellen die nachstehenden Daten keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 2,87%, AA: 15,73%, A: 15,63%, BBB: 31,55%, BB: 18,89%, B: 2,54%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: -1,06%, Keine Datenabdeckung**: 13,86%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	4,70	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,84	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	4,19	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 61,16%, Gelb: 11,65%, Orange: 8,08%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 4,26%, Keine Datenabdeckung**: 14,86%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 19,39%, Neutral: 74,87%, Negativ: 3,51%, Nicht bewertbar**: 1,00%, Keine Datenabdeckung**: 1,23%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

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

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

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, CO₂- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).
- Investitionen, 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 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 nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 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.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.955,67	93,80	77,32
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1.348,50	93,80	77,32
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	41.894,70	93,80	76,98
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	45.946,36	93,80	76,92
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	771,05	93,80	76,92
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	1.294,43	93,80	80,01
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	14,90	93,80	80,46
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	48,23	93,80	60,02
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	93,80	64,32
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,10	93,80	64,32

6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,23	93,80	64,32
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	93,80	64,32
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	93,80	64,32
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	93,80	64,32
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	93,80	64,32
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	93,80	64,32
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	93,80	64,32
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	93,80	80,67
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,02	93,80	1,11
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	523,73	93,80	29,33
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	93,80	80,46
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)	37,32	93,80	80,36
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	1,59	93,80	8,88
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	16,14	93,80	80,29
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	93,80	80,46
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	30,29	4,78	3,12
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0	4,78	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	4,51	4,78	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.10.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS (BVI) LTD / 5,125% / 15.05.2024	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,56	Südafrika
GRUPO BIMBO SAB DE CV / 3,875% / 27.06.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,01	Mexiko
MASHREQBANK PSC / 4,250% / 26.02.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,01	Vereinigte Arabische Emirate
MIZUHO FINANCIAL GROUP (CAYMAN) 3 LTD / 4,600% / 27.03.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,01	Japan
MTN (MAURITIUS) INVESTMENTS LTD / 4,755% / 11.11.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,01	Südafrika
WOORI BANK / 4,750% / 30.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,00	Korea, Republik
UNITED STATES TREASURY / 04.04.2024	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,97	Vereinigte Staaten von Amerika
POWER FINANCE CORPORATION LTD / 3,250% / 16.09.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,97	Indien
IHS HOLDING LTD / 5,625% / 29.11.2026	J. Information und Kommunikation	1,50	Vereinigtes Königreich
BANCO SANTANDER MEXICO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE / 5,375% / 17.04.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,48	Spanien
ECOPETROL SA / 8,625% / 19.01.2029	B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,44	Kolumbien
PROSUS NV / 3,257% / 19.01.2027	J. Information und Kommunikation	1,44	Südafrika
UNITED STATES TREASURY / 04.01.2024	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,40	Vereinigte Staaten von Amerika
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD / 2,625% / 30.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,32	Korea, Republik
AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK / 4,125% / 20.06.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,21	Afrika, supranational

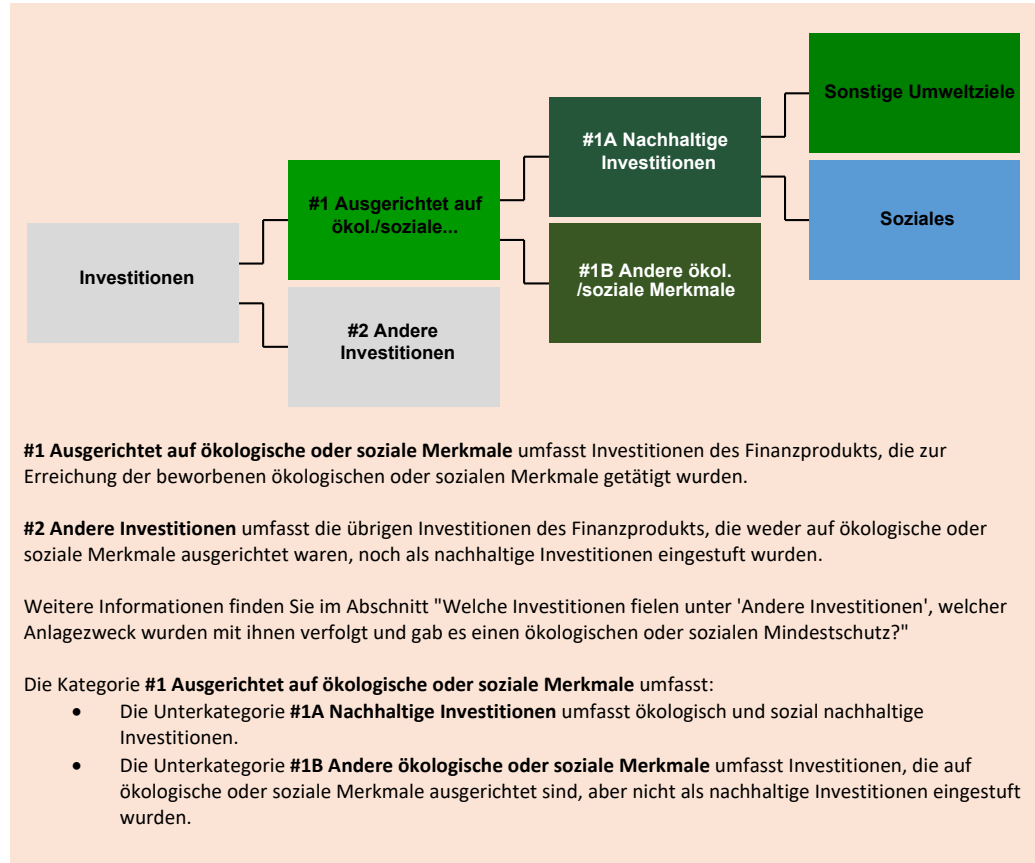
* *Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.*



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 93,03% seines Gesamtvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 11,38% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 81,65% seines Gesamtvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 6,97% seines Gesamtvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.10.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

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

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,30%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	12,05%
C. Verarbeitendes Gewerbe	9,86%
D. Energieversorgung	2,62%
F. Baugewerbe	0,17%
H. Verkehr und Lagerei	0,89%
J. Information und Kommunikation	6,63%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	57,32%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	0,46%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,54%

N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,02%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	5,41%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	1,14%
Andere	1,61%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 Teilssektoren 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	6,14%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,41%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,28%
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 Mineralölerzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.10.2023. 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 CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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



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

Zum 31.10.2023 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 sind¹?

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

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

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

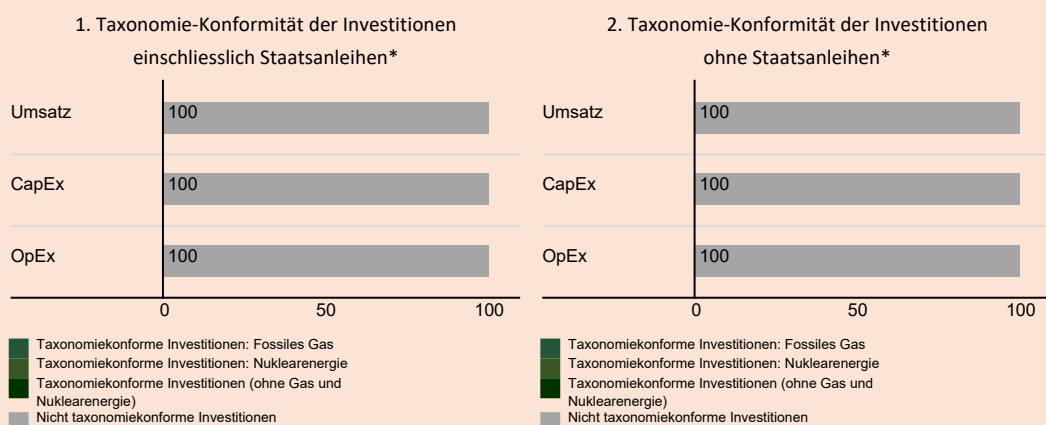
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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 31.10.2023 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?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.10.2022 bei 0,00%.



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

Zum 31.10.2023 waren 10,75% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.10.2023 waren 0,63% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.10.2023 waren 6,97% 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 verstieszen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

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

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

Keine Angaben

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

- **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.



CS Investment Funds 1
5, rue Jean Monnet
L-2180 Luxembourg
www.credit-suisse.com