

CS Investment Funds 4

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital

luxemburgischen Rechts – R.C.S. Luxembourg B134528

**Ungeprüfter Halbjahresbericht
zum 31.05.2024**

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
Kombinierter Bericht	5
Erläuterungen	7
Bericht per Subfonds	
Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund	12
Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)	16
Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund	19
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	25
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	30
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	35
Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta	45
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation)	59
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023)	62
Ungeprüfte Angaben	
Vergütung	65
Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("CSFT") und Total-Return-Swaps ("TRS")	65

Verwaltung und Organe

Die Gesellschaft

CS Investment Funds 4
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg
R.C.S. Luxemburg B134528

Verwaltungsrat der Gesellschaft

Marc Berryman
Director, UBS Asset Management (UK) Ltd.

Jonathan Griffin
Independent Director, Luxemburg

Eduard von Kymmel
Independent Director, Luxemburg

Petra Borisch
Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Evanthi Savoulidi
Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft

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

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

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

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

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

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

Abschlussprüfer der Verwaltungsgesellschaft

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

Vertreter in der Schweiz

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

UBS Fund Management (Switzerland) AG (seit dem 01.05.2024)
Aeschenvorstadt 1, 4051 Basel

Zahlstelle in der Schweiz

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

Depotbank

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

Vertriebsstelle

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

Anlageverwalter

Credit Suisse Asset Management LLC (bis zum 30.04.2024)
One Madison Avenue, New York, NY 10010, USA

UBS Asset Management (Americas) LLC (seit dem 01.05.2024)
1285 Avenue of the Americas, New York, NY 10019, USA

- Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta

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

- Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)
- Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR
- Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR
- Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD
- Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund
(in Liquidation)
- Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund
(bis zum 08.12.2023)
- Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund

Credit Suisse Insurance Linked Strategies Ltd.
Europaallee 1, CH 8004 Zürich

- Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund

Zentrale Verwaltungsstelle

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

Vertreter und Zahlstellen ausserhalb von Luxemburg und der Schweiz

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

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

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

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

Nettovermögensaufstellung (in USD)**31.05.2024****Aktiva**

Wertpapierbestand zum Marktwert	1.149.959.327,39
Bareinlagen bei Banken und Brokern	71.497.700,60
Forderungen aus Zeichnungen	19.809,20
Forderungen aus Erträgen	4.523.907,90
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten	994.813,16
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten	62.108,26
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	969.856,07
Andere Aktiva	3.179,50
	1.228.030.702,08

Passiva

Bankverbindlichkeiten und sonstige	932.807,51
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	318.220,00
Rückstellungen für Aufwendungen	1.361.534,52
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	4.698.149,31
Andere Passiva	89,68
	7.310.801,02

Nettovermögen 1.220.719.901,06

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens (in USD)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	1.976.069.594,89
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	6.857.494,00
Dividenden (Netto)	4.929.196,21
Bankzinsen	2.429.156,19
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	121.958,35
Andere Erträge	108.050,61
	14.445.855,36
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	6.878.972,48
"Performance fee"	2.660,46
Depotbank- und Depotgebühr	482.814,61
Zentralverwaltungsvergütung	467.877,00
Druck- und Veröffentlichungskosten	36.807,90
Zinsen und Bankspesen	66.276,66
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	652.257,23
"Taxe d'abonnement"	119.333,79
	8.707.000,13
Nettoerträge (-verluste)	5.738.855,23
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	16.791.432,53
Risikoprämie auf Cat-Bonds	3.420.556,92
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	8.594.289,55
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	8.382.936,33
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-8.871.475,83
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	592.684,20
	28.910.423,70
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	34.649.278,93
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	42.392.319,69
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	-169.409,18
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-840.796,15
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-7.720.951,44
	33.661.162,92
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	68.310.441,85
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	168.658.610,81
Rücknahmen	-984.374.625,25
	-815.716.014,44
Ausschüttung	-4.703.718,92
Währungsdifferenz	-3.240.402,32
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	1.220.719.901,06

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Erläuterungen

Allgemeines

CS Investment Funds 4 (die "Gesellschaft") wurde am 30.11.2007 als offener Investmentfonds in der Rechtsform einer Investmentgesellschaft mit variablem Kapital ("Société d'investissement à capital variable") gemäss Teil des Luxemburger Gesetzes vom 17.12.2010 betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner neuesten Fassung gegründet.

Zum 31.05.2024 hatte die Gesellschaft 7 Subfonds aufgelegt.

Änderungen:

Ab dem 07.12.2023 wurde der Liquidationsprozess des Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund eingeleitet.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, den Subfonds Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund zum 08.12.2023 zu liquidieren. Der Liquidations-NIW wurde zum 11.12.2023 berechnet.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, den Subfonds Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund zum 06.02.2024 zu liquidieren. Der Liquidations-NIW wurde zum 09.02.2024 berechnet.

Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

a) Darstellung des Abschlusses

Die Abschlüsse wurden gemäß den in Luxemburg für Investmentfonds geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unter der Annahme der Fortführung der Geschäftstätigkeit (going concern) erstellt, mit Ausnahme der Subfonds Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund, für den ab dem 07.12.2023 der Liquidationsprozess eingeleitet wurde, Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund, der am 08.12.2023 liquidiert wurde, und Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund, der am 06.02.2024 liquidiert wurde.

b) Berechnung des Nettoinventarwerts der einzelnen Subfonds

Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta:

Der Nettoinventarwert der Aktien des Subfonds wird an jedem Bankgeschäftstag in Luxemburg, an dem Banken in Luxemburg und New York gantztägig für den Geschäftsverkehr geöffnet sind (jeweils ein "Bewertungstag"), ermittelt.

Bei aktiven Subfonds berücksichtigt der Abschluss die am 31.05.2024 berechneten Nettoinventarwerte.

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.

Unter besonderen Umständen kann die Gesellschaft im Interesse der Aktionäre beschliessen, den oben angegebenen maximalen Swing-Faktor zu erhöhen.

Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024), Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR, Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR, Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD, Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation) und Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023):

Der Nettoinventarwert der Aktien der jeweiligen Subfonds wird auf täglicher Basis berechnet.

Bei aktiven Subfonds berücksichtigt der Abschluss die am 31.05.2024 berechneten Nettoinventarwerte.

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.

Unter besonderen Umständen kann die Gesellschaft im Interesse der Aktionäre beschliessen, den oben angegebenen maximalen Swing-Faktor zu erhöhen.

Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund:

Der Nettoinventarwert der Aktien des Subfonds wird an jedem Bankarbeitstag in Luxemburg, an dem Banken in Luxemburg, London und Zürich gantztägig für den Geschäftsverkehr geöffnet sind (jeweils ein "Bewertungstag"), ermittelt.

Bei aktiven Subfonds berücksichtigt der Abschluss die am 31.05.2024 berechneten Nettoinventarwerte.

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.

Unter besonderen Umständen kann die Gesellschaft im Interesse der Aktionäre beschliessen, den oben angegebenen maximalen Swing-Faktor zu erhöhen.

Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund:

Der Nettoinventarwert der Aktien des Subfonds wird auf wöchentlicher Basis an jedem Montag berechnet. Ist der Montag kein Bankgeschäftstag in Luxemburg, erfolgt die Berechnung an dem darauf folgenden Bankgeschäftstag in Luxemburg (ein "Bewertungstag"). Unabhängig davon wird der Nettoinventarwert der Aktien des Subfonds jeweils am Monatsende berechnet.

Der Abschluss berücksichtigt die am 31.05.2024 berechneten Nettoinventarwerte. 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.

Unter besonderen Umständen kann die Gesellschaft im Interesse der Aktionäre beschliessen, den oben angegebenen maximalen Swing-Faktor zu erhöhen.

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 Aktionäre vor solchen Kapitalschwankungen zu schützen, wird daher eine Anpassung des verwendeten NIW pro Aktie vorgenommen, wenn die Netto-Kapitalschwankungen einen vom Verwaltungsrat festgelegten Grenzwert überschreiten. Diese Anpassung spiegelt die geschätzten Steuern und Handelskosten wider, die dem Subfonds durch diese Transaktionen entstehen können, sowie die geschätzte Geld-Brief-Spanne der Vermögenswerte, in die der Subfonds investiert. Es werden regelmässige Überprüfungen durchgeführt, um festzustellen, ob der angewendete Swing-Faktor angemessen ist.

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

Alle Subfonds wenden ein teilweises Single-Swing-Pricing an.

Zum 31.05.2024 wurde kein Single-Swing-Pricing angewendet.

c) Bewertung des Wertpapierbestands des jeweiligen Subfonds
Wertpapiere, die an einer Wertpapierbörse kotiert sind oder regelmässig gehandelt werden, werden zum zuletzt verfügbaren Handelspreis bewertet. Steht ein solcher Kurs an einem bestimmten Handelstag nicht zur Verfügung, kann der Mittelkurs (der Mittelwert von Brief- und Geldkurs) oder alternativ der Geldkurs als Bewertungsgrundlage herangezogen werden.

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

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

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

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

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

Der Bewertungspreis eines Geldmarktinstruments mit einer Laufzeit oder Restlaufzeit von weniger als 397 Tagen und keiner spezifischen Sensitivität für Marktparameter, einschliesslich des Kreditrisikos, wird, ausgehend vom Nettoerwerbskurs bzw. vom Kurs zu dem Zeitpunkt, zu welchem die Restlaufzeit einer Anlage drei Monate unterschreitet, und unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessive dem Rückzahlungskurs angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen muss die Grundlage für die Bewertung verschiedener Anlagen an den neuen Marktrenditen ausgerichtet werden.

Sofern eine Bewertung gemäss den vorstehenden Regeln aufgrund besonderer oder geänderter Umstände nicht möglich oder fehlerhaft ist, kann der Verwaltungsrat der Gesellschaft andere allgemein anerkannte und prüffähige Bewertungsgrundsätze anwenden, um eine ordnungsgemässe Bewertung des Subfondsvermögens zu erreichen.

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

e) Realisierte Nettogewinne/-verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren jedes Subfonds
Die aus Verkäufen von Wertpapieren resultierenden realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises berechnet.

f) Währungsumrechnung
Der Abschluss wird in der Referenzwährung der einzelnen Subfonds erstellt, und der kombinierte Abschluss wird in USD erstellt.
Guthaben bei Banken, anderes Nettovermögen sowie der Wert von Wertpapieren des Portfolios, die auf andere Währungen lauten als die Referenzwährung des jeweiligen Subfonds, werden zu dem am Bewertungstag geltenden Wechselkurs in die Referenzwährung umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des jeweiligen Subfonds lauten, werden zu dem Wechselkurs, der an dem Tag gilt, an dem sie dem Subfonds entstehen, in die Referenzwährung umgerechnet.
Währungsgewinne oder -verluste werden im Abschluss unter "Ertrags- und Aufwandsrechnung" berücksichtigt.

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

g) Buchung von Wertpapiertransaktionen der einzelnen Subfonds
Die Wertpapiergeschäfte werden an den Transaktionstagen gebucht.

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

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

j) Bewertung von Optionen jedes Subfonds
Auf ausgegebene Optionen vereinnahmte Prämien werden in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeiten ausgewiesen, auf den Kauf von Optionen gezahlte Prämien als Vermögenswerte. Zum Bilanzstichtag ausstehende Optionskontrakte werden zum letzten Abrechnungs- oder Schlusspreis an den Börsen oder geregelten Märkten bewertet. Realisierte Gewinne oder Verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderungen des Nettovermögens" ausgewiesen.

k) Bewertung von Swaps
An jedem Bewertungstag werden Swap-Vereinbarungen zum Nettobarwert der künftigen Cashflows anhand der betreffenden Zinsstrukturkurve am Bewertungstag bewertet.
Bei der Bewertung von Excess Return Swaps wird der jeweilige Basiswert berücksichtigt.
Die daraus resultierenden nicht realisierten Gewinne und Verluste werden unter dem nicht realisierten Gewinn/Verlust aus Swap-Kontrakten in der Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden auch in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" verbucht unter "Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swap-Kontrakten".

l) 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.

m) 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 oder von erstklassigen Finanzinstituten, die auf diese Art von Geschäften spezialisiert sind, organisiert wird.

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

o) Sonstige Erträge
Während des Berichtszeitraums/Berichtsjahrs von den Subfonds vereinnahmte Bestandsprovisionen für Anlagen in bestimmten Zielfonds werden unter "Sonstige Erträge" 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 Durchschnitt der täglichen Nettoinventarwerte des jeweiligen Subfonds in dem entsprechenden Monat.

Für den Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR, Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR, Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD, Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta, Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation), Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023): Neben den Aufwendungen der Gesellschaft für die Verwaltung des Subfonds wird unabhängig davon vom Vermögen des Subfonds für die darin enthaltenen Zielfonds eine Verwaltungsgebühr abgezogen.

Erläuterungen

Performancegebühr

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Zusätzlich zur Verwaltungsgebühr hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Performancegebühr für folgende Subfonds:

- Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund
- Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)

Eine detaillierte Beschreibung der Berechnungsmethode für die Performancegebühren ist dem Prospekt der Gesellschaft zu entnehmen.

Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf eine Performancegebühr für den Subfonds, die täglich 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 ist jährlich zahlbar (d. h. wird festgeschrieben) ("Festschreibungszeitraum"). Der Festschreibungszeitraum endet am 30. November, wobei der erste Festschreibungszeitraum möglicherweise länger ist, da er mit der Auflegung der betreffenden Aktienklasse beginnt und mindestens zwölf Monate lang ist.

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 Festschreibungszeitraums zahlbar sowie bei Rücknahmen von Aktien während des Festschreibungszeitraums. Der im Nettoinventarwert pro Aktie enthaltene Betrag der Performancegebühr für diese zurückgenommenen Aktien wird an dem Tag der Rückgabe durch den Aktionär anteilig fällig (d. h. festgeschrieben), wenn folgende Bedingungen erfüllt sind:

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 anfiel, ausgeglichen werden.

Wenn der Nettoinventarwert einer Aktienklasse ohne Anwendung des Swing-Pricing am Berechnungstag höher ist als die vorherigen Nettoinventarwerte ohne Anwendung des Swing-Pricing (vor Abzug der Performancegebühr), wird eine Performancegebühr von 10% der Differenz zwischen dem Nettoinventarwert der Aktienklasse ohne Anwendung von Swing-Pricing und der High Water Mark abgezogen.

Die Performancegebühr wird auf der Grundlage der zu diesem Zeitpunkt während des Festschreibungszeitraums im Umlauf befindlichen Aktien der betreffenden Aktienklasse berechnet, während die Auswirkung neuer Zeichnungen neutralisiert wird. Neue Zeichnungen sind daher erst von der Performancegebühr betroffen, wenn sie zur Performance der betreffenden Aktienklasse beigetragen haben.

Wenn über einen Zeitraum von fünf Jahren keine Performancegebühr fällig wird, wird die High Water Mark an diesem Tag bei der nächsten NIW-Berechnung zurückgesetzt auf den NIW ohne Anwendung von Swing-Pricing am Ende des Fünfjahreszeitraums ("Vortragsbedingungen").

Aktienklasse	Währung	Satz der Performancegebühr	Betrag der für den Zeitraum berechneten Performancegebühr	Auf den NIW der Aktienklasse für den Zeitraum erhobene Performancegebühr in %
EA	USD	10%	-	-
EBH	CHF	10%	2.660,46	0,32%

Die zum Ende des Berichtszeitraums berechnete Performancegebühr belief sich auf 2.660,46 CHF.

Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)

Die Performancegebühr wird bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der betreffenden Aktienklasse berechnet.

Die Performancegebühr wird nur fällig und festgeschrieben, 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 im Prospekt der Gesellschaft 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 wird und täglich auf indexierter Basis berechnet wird.

Referenzwährung der Aktienklasse	Referenzzinssatz	Benchmark-Administrator
USD	SOFR	FED
EUR	ESTR	EZB
CHF	SARON	SIX
GBP	SONIA	BOE
JPY	TONAR	BOJ

Die Berechnung des Hurdle-Rate-Index-Wertes beginnt mit der Auflegung des Subfonds, und er wird nur zurückgesetzt, wenn die Vortragsbedingungen erfüllt wurden. Einige Benchmark-Administratoren, die Zentralbanken sind, fallen gemäss Artikel 2 (a) der Benchmark-Verordnung nicht in den Geltungsbereich dieser Verordnung. SIX steht gemäss Artikel 33 der Benchmark-Verordnung unter der Aufsicht der FINMA (Schweizer Finanzmarktaufsicht) und ist in dem gemäss Artikel 36 der Benchmark-Verordnung von der ESMA geführten Register von Administratoren eingetragen.

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 Performancegebühr wird auf der Grundlage der zu diesem Zeitpunkt während des Festschreibungszeitraums im Umlauf befindlichen Aktien der betreffenden Aktienklasse berechnet, während die Auswirkung neuer Zeichnungen neutralisiert wird. Neue Zeichnungen sind daher erst von der Performancegebühr betroffen, wenn sie zur Performance der betreffenden Aktienklasse beigetragen haben.

Die Performancegebühr ist jährlich am 30. November zahlbar (d. h. wird festgeschrieben) ("Festschreibungszeitraum").

Wenn über den Performance-Referenzzeitraum von bis zu fünf Jahren keine Performancegebühr fällig wird, werden die High Water Mark und der Hurdle-Rate-Index-Wert an diesem Tag bei der nächsten NIW-Berechnung zurückgesetzt auf den NIW ohne Anwendung von Swing-Pricing am Ende des Fünfjahreszeitraums ("Vortragsbedingungen").

Aktienklasse	Währung	Satz der Performancegebühr	Betrag der für den Zeitraum berechneten Performancegebühr	Auf den NIW der Aktienklasse für den Zeitraum erhobene Performancegebühr in %
B	USD	15%	-	-
BH	CHF	15%	-	-
BH	EUR	15%	-	-
IB	USD	15%	-	-
UB	USD	15%	-	-
UBH	CHF	15%	-	-
UBH	EUR	15%	-	-

Über den Zeitraum wurde keine Performancegebühr erhoben.

Verwaltungskosten und Depotgebühren

Für den Zweck der Verwahrung und Verwaltung muss das Unternehmen der Depotbank und dem Verwalter eine Gebühr zahlen, die auf dem NIW des Subfonds beruht und am Ende jedes Monats fällig wird.

"Taxe d'abonnement"

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

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

Wechselkurse

Der konsolidierte Abschluss wird in USD erstellt. Zu diesem Zweck wird der Abschluss der einzelnen Subfonds zu dem am 31.05.2024 geltenden Wechselkurs in USD umgerechnet:

1 USD = 0,921150 EUR

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

Die TER bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem jeweiligen Subfonds belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens.

Investiert ein Subfonds mindestens 10% seines Nettovermögens in Zielfonds, 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, und der TER des Dachfonds per Stichtag des Dachfonds, abzüglich der in der Berichtsperiode/im Berichtsjahr vereinnahmten Retrozessionen von Zielfonds. Die TER wird nach der AMAS-Richtlinie berechnet.

Fondsperformance (siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die Performance des Jahres N basiert auf den am letzten Geschäftstag des Kalenderjahres N bzw. N-1 berechneten Nettoinventarwerten. Diese Nettoinventarwerte spiegeln die Marktpreise der Investitionen wider, die am letzten Geschäftstag der Berichtsperiode N-1 bzw. N ermittelt wurden.

Die Performance seit Jahresbeginn (YTD) bezieht sich auf den Zeitraum vom 01.01.2024 bis zum 31.05.2024.

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

Bei den Performanceangaben sind bei der Ausgabe und Rücknahme von Aktien der Gesellschaft erhobene Kosten und Kommissionen nicht berücksichtigt.

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

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.

Transaktionskosten

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

In dem am 31.05.2024 abgeschlossenen Berichtszeitraum entstanden den Subfonds folgende Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Kauf oder Verkauf von Wertpapieren und ähnlichen Geschäften (einschliesslich derivativer Finanzinstrumente oder anderer zulässiger Vermögenswerte):

Subfonds	Währung	Transaktionskosten
Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund	USD	22.450,71
Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)	USD	862,58
Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	EUR	2.827,25
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	EUR	3.444,06
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	23.959,56
Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta	USD	15.619,83
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation)	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023)	USD	0,00

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

Wertpapierleihe

Die Subfonds partizipierten am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich. Der Marktwert der Wertpapierleihe und der Marktwert der Sicherheiten waren zum 31.05.2024 wie folgt:

Subfonds	Währung	Marktwert der Wertpapierleihe	Marktwert der Sicherheiten
Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund	USD	37.066.234,00	39.028.674,37
Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	EUR	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	EUR	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	10.961.203,00	11.541.534,61
Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation)	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023)	USD	0,00	0,00

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 operativen Kosten solcher Wertpapierleihgeschäfte werden vom Wertpapierleihagenten von seinen Gebühren bezahlt.

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 den Berichtszeitraum zum 31.05.2024 belief sich die an den Principal gezahlte Gebühr auf folgende Beträge:

Subfonds	Währung	Bruttobetrag Wertpapierleihe	Aufwendungen und Provisionen von der Gegenpartei der Wertpapierleihgeschäfte	Nettobetrag des Ertrags aus Wertpapierleihe
Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund	USD	52.596,91	10.519,38	42.077,53
Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)	USD	0,00	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	EUR	14.522,64	2.904,53	11.618,11
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	EUR	18.984,18	3.796,84	15.187,34
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	63.397,08	12.679,42	50.717,66
Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta	USD	0,00	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation)	USD	0,00	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023)	USD	0,00	0,00	0,00

Subfondsübergreifende Anlagen

Folgende Anlagen wurden nicht aus den konsolidierten Zahlen herausgenommen. Zum 31.05.2024 belief sich der konsolidierte NIW der Gesellschaft ohne diese Anlagen auf insgesamt USD 1.213.187.840,78.

Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR

Subfonds, in den investiert wird	Bewertung (in EUR)
Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund -EA- USD	6.938.157,33
	6.938.157,33

Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

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

Bedeutendes Ereignis während des Berichtszeitraums

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

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

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

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

Mit Wirkung zum 1. Mai 2024 wurde Credit Suisse Asset Management LLC, der Anlageverwalter des Subfonds Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta, durch UBS Asset Management (Americas) LLC ersetzt.

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 19. Juni 2024 beschloss der Verwaltungsrat, den CS Investment Funds 4 - Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR mit dem UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (EUR) zusammenzulegen. Die Fusion wird am 26. Juli 2024 wirksam.

Am 19. Juni 2024 beschloss der Verwaltungsrat, den CS Investment Funds 4 - Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR mit dem UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (EUR) zusammenzulegen. Die Fusion wird am 26. Juli 2024 wirksam.

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
EA - Ausschüttend	USD	58213722	LU2258001382	0,45%	0,62%
EBH - Thesaurierend	CHF	135047272	LU2818313053	0,45%	0,84%

Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund -EBH- CHF wurde am 15.05.2024 lanciert.
Die TER ohne Performancegebühr für -EBH- CHF beträgt 0,52%.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
EA - Ausschüttend	USD	4,45%	/	2,96%	-8,21%	3,20%
EBH - Thesaurierend	CHF	/	0,35%	/	/	/

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
EA - Ausschüttend	USD	16.01.2024	10,16

Erläuterungen

Finanzterminkontrakte

Beschreibung	Währung	Anzahl	Verpflichtungen (in Währung des Terminkontrakts)	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>				
FINEX USD INDEX CURRENCY -1000- 17/06/24	USD	123	12.869.121,00	202.603,40
MSCI EAFE INDEX -50- 21/06/24	USD	186	22.042.860,00	276.405,00
MSCI EMERGING MARKETS INDEX -50- 21/06/24	USD	-90	-4.754.250,00	16.730,00
NASDAQ 100 E-MINI INDEX -20- 21/06/24	USD	20	7.436.400,00	105.048,72
RUSSELL INDICES INDEX -50- 21/06/24	USD	137	14.219.230,00	-145.847,38
S&P E-MINI ENERGY SELECT SECTOR INDEX -1	USD	63	6.151.320,00	-366.220,91
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 19/	USD	-222	-24.152.906,25	50.296,99

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten

139.015,82

Gegenpartei: Credit Suisse (Schweiz) AG

Devisentermingeschäfte

Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>			
CHF 470.000	USD -515.416	11.06.2024	6.213,54
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			
CHF 125.000	USD -137.034	11.06.2024	1.697,02
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			
CHF 8.577.500	USD -9.416.490	11.06.2024	103.256,48
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			
CHF 8.577.500	USD -9.431.265	25.06.2024	103.655,26
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>			

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften

214.822,30

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.05.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		102.683.797,45			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		6.033.672,01			
Forderungen aus Erträgen		247.635,26			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten		139.015,82			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		214.822,30			
		109.318.942,84			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		165,13			
Rückstellungen für Aufwendungen		90.589,87			
		90.755,00			
Nettovermögen		109.228.187,84			
Teilfondsentwicklung		31.05.2024	30.11.2023	30.11.2022	
Teilfondsvermögen	USD	109.228.187,84	187.392.719,08	236.447.785,19	
Nettoinventarwert pro Aktie					
EA - Ausschüttend	USD	1.009,66	962,92	958,58	
EBH - Thesaurierend	CHF	1.003,46	/	/	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
EA - Ausschüttend	USD	88.628,000	194.608,000	7.466,944	113.446,944
EBH - Thesaurierend	CHF	17.750,000	0,000	17.750,000	0,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	187.392.719,08
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	952.697,46
Dividenden (Netto)	183.064,59
Bankzinsen	176.502,06
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	42.077,53
	1.354.341,64
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	417.822,26
"Performance fee"	2.660,46
Depotbank- und Depotgebühr	58.158,88
Zentralverwaltungsvergütung	55.211,46
Druck- und Veröffentlichungskosten	752,26
Zinsen und Bankspesen	332,22
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	36.658,29
"Taxe d'abonnement"	8.330,78
	579.926,61
Nettoerträge (-verluste)	774.415,03
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-503.390,98
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	8.172.089,00
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-588.471,31
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	307.790,05
	7.388.016,78
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	8.162.431,79
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	2.525.607,91
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	-263.446,30
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	575.294,18
	2.837.455,79
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	10.999.887,58
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	26.791.105,30
Rücknahmen	-113.983.813,56
	-87.192.708,26
Ausschüttung	-1.971.710,56
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	109.228.187,84

Aufstellung des Wertpapierbestandes**Geographische Aufteilung**

Vereinigte Staaten	94,01
Total	94,01

Wirtschaftliche Aufteilung

Länder und Zentralregierungen	94,01
Total	94,01

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	9.500.000	9.285.878,93	8,50
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-31.10.2024	9.500.000	9.360.507,86	8,59
USD US TREASURY N/B 2.25%/18-31.12.2024	9.500.000	9.336.718,75	8,55
USD US TREASURY N/B S AR-2024 0.375%/21-150824	9.500.000	9.406.113,31	8,61
USD US TREASURY N/B S. -K-2025- 2.875%/18-30.04.2025	9.500.000	9.303.691,43	8,52
USD US TREASURY N/B S. -U-2025- 1.375%/20-31.01.2025	9.500.000	9.261.386,70	8,48
USD US TREASURY N/B S. -W-2025- 0.5%/20-31.03.2025	9.500.000	9.141.894,56	8,37
Total Anleihen		65.116.191,54	59,61
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
		65.116.191,54	59,61
Geldmarktinstrumente			
USD TREASURY BILL 0%/23-050924	9.500.000	9.372.606,07	8,58
USD TREASURY BILL 0%/23-130624	9.500.000	9.482.455,69	8,68
USD TREASURY BILL 0%/23-291124	9.500.000	9.267.162,67	8,48
USD WI TREASURY BILL 0%/23-110724	9.500.000	9.445.381,48	8,65
Total Geldmarktinstrumente		37.567.605,91	34,39
Total des Wertpapierbestandes		102.683.797,45	94,01
Bareinlagen bei Banken und Brokern		6.033.672,01	5,52
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-165,13	0,00
Andere Nettovermögenswerte		510.883,51	0,47
Teilfondsvermögen		109.228.187,84	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
B - Thesaurierend	USD	37844835	LU1663962121	0,85%
IB - Thesaurierend	USD	38090165	LU1675761842	0,45%
UB - Thesaurierend	USD	38090044	LU1675761503	0,50%
BH - Thesaurierend	CHF	38090043	LU1675761412	0,85%
UBH - Thesaurierend	CHF	38090161	LU1675761685	0,50%
BH - Thesaurierend	EUR	38089961	LU1675761339	0,85%
UBH - Thesaurierend	EUR	38090163	LU1675761768	0,50%

Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund -UB- USD wurde am 19.12.2023 geschlossen.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, den Teilfonds Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund zum 06.02.2024 zu liquidieren, der Liquidations-NIW wurde zum 09.02.2024 berechnet.

Fondsperformance

		PTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	USD	0,60%	/	6,20%	-14,65%	6,32%
IB - Thesaurierend	USD	0,65%	/	6,63%	-14,31%	6,70%
UB - Thesaurierend	USD	/	/	/	-14,36%	6,65%
BH - Thesaurierend	CHF	0,18%	/	1,61%	-17,05%	5,06%
UBH - Thesaurierend	CHF	0,22%	/	1,97%	-16,77%	5,40%
BH - Thesaurierend	EUR	0,44%	/	3,61%	-16,78%	5,25%
UBH - Thesaurierend	EUR	0,47%	/	3,97%	-16,48%	5,59%

PTD = Performance To Date (01.01.2024 - 06.02.2024)

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

Teilfondsentwicklung		06.02.2024	30.11.2023	30.11.2022
Teilfondsvermögen	USD	17.955.608,00*	18.775.289,10	18.723.191,23
Nettoinventarwert pro Aktie				
B - Thesaurierend	USD	112,50	109,36	105,97
IB - Thesaurierend	USD	1.150,85	1.117,81	1.078,80
UB - Thesaurierend	USD	/	111,48	107,64
BH - Thesaurierend	CHF	94,73	92,85	94,02
UBH - Thesaurierend	CHF	96,49	94,51	95,37
BH - Thesaurierend	EUR	97,99	95,58	95,01
UBH - Thesaurierend	EUR	99,95	97,43	96,51

* TNA vor Liquidation.

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	USD	0.000	17.080,372	0.000	17.080,372
IB - Thesaurierend	USD	0.000	11.267,000	0.000	11.267,000
UB - Thesaurierend	USD	0.000	2.070,000	0.000	2.070,000
BH - Thesaurierend	CHF	0.000	8.398,751	0.000	8.398,751
UBH - Thesaurierend	CHF	0.000	6.971,000	0.000	6.971,000
BH - Thesaurierend	EUR	0.000	18.962,365	0.000	18.962,365
UBH - Thesaurierend	EUR	0.000	4.234,872	0.000	4.234,872

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

Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
06.02.2024
(Liquidationsdatum)

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	18.775.289,10
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	70.416,46
Dividenden (Netto)	27.847,77
Bankzinsen	5.728,66
	103.992,89
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	19.996,26
Depotbank- und Depotgebühr	2.247,53
Zentralverwaltungsvergütung	2.158,69
Druck- und Veröffentlichungskosten	1.978,00
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	34.575,07
"Taxe d'abonnement"	738,32
	61.693,87
Nettoerträge (-verluste)	42.299,02
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	27.061,71
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	63.924,04
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-51.914,19
	39.071,56
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	81.370,58
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	464.705,75
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-67.706,51
	396.999,24
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	478.369,82
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	0,00
Rücknahmen	-19.253.658,92
	-19.253.658,92
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	0,00

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
DB - Thesaurierend	USD	123779338	LU2567397554	0,00%	0,15%
EB - Thesaurierend	USD	57847443	LU2250179053	0,80%	1,40%
IB - Thesaurierend	USD	122198149	LU2542782037	1,30%	2,01%
UB - Thesaurierend	USD	57853254	LU2250179723	0,90%	/
EBH - Thesaurierend	CHF	57847447	LU2250179137	0,80%	1,50%
UBH - Thesaurierend	CHF	57853256	LU2250179996	0,90%	1,68%
EBH - Thesaurierend	EUR	57847788	LU2250179210	0,80%	1,51%
IBH - Thesaurierend	EUR	57847439	LU2250178915	1,30%	2,09%
UBH - Thesaurierend	EUR	57853260	LU2250180069	0,90%	1,68%

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die -DB- Aktien.

Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund -UB- USD wurde am 28.03.2024 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022
DB - Thesaurierend	USD	4,91%	21,70%	/	/
EB - Thesaurierend	USD	4,29%	38,50%	15,18%	-2,04%
IB - Thesaurierend	USD	4,11%	24,00%	14,52%	/
UB - Thesaurierend	USD	/	/	/	-2,15%
EBH - Thesaurierend	CHF	2,65%	12,30%	10,95%	-4,46%
UBH - Thesaurierend	CHF	2,51%	10,40%	10,92%	-4,62%
EBH - Thesaurierend	EUR	3,59%	18,40%	13,06%	-3,99%
IBH - Thesaurierend	EUR	3,39%	13,00%	12,45%	-4,42%
UBH - Thesaurierend	EUR	3,55%	16,70%	12,81%	-3,94%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
USD	1.222.254	NZD	-2.041.500	11.06.2024	-31.996,53
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	8.300	USD	-9.170	11.06.2024	41,79
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	980	USD	-1.055	11.06.2024	9,66
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	350.200	USD	-376.673	11.06.2024	3.677,10
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	152.600	USD	-164.136	11.06.2024	1.602,30
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	5.409.717	EUR	-5.032.300	11.06.2024	-55.807,97
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	5.100	USD	-5.541	11.06.2024	-1,60
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	2.420	USD	-2.604	11.06.2024	23,87
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	9.300	USD	-10.009	11.06.2024	91,73
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.101.900	USD	-1.185.197	11.06.2024	11.569,95
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	4.702.300	USD	-5.187.417	11.06.2024	31.435,51
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	661.800	USD	-730.075	11.06.2024	4.424,22
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	357.800	USD	-388.962	25.06.2024	-99,83
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	152.600	USD	-165.890	25.06.2024	-42,57
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
EUR	1.101.900	USD	-1.197.868	25.06.2024	-307,43
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	661.800	USD	-727.783	25.06.2024	7.887,13
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	4.702.400	USD	-5.171.240	25.06.2024	56.041,74
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					28.549,07

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

	31.05.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	99.854.339,94
Bareinlagen bei Banken und Brokern	564.356,05
Forderungen aus Erträgen	1.998.580,61
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	28.549,07
	102.445.825,67
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	30.366,34
	30.366,34
Nettovermögen	102.415.459,33

Teilfondsentwicklung		31.05.2024	30.11.2023	30.11.2022
Teilfondsvermögen	USD	102.415.459,33	33.739.529,28	65.372.958,09
Nettoinventarwert pro Aktie				
DB - Thesaurierend	USD	12,17	11,49	/
EB - Thesaurierend	USD	13,85	13,15	11,39
IB - Thesaurierend	USD	12,40	11,81	10,28
UB - Thesaurierend	USD	/	12,97	11,25
EBH - Thesaurierend	CHF	11,23	10,86	9,79
UBH - Thesaurierend	CHF	11,04	10,68	9,65
EBH - Thesaurierend	EUR	11,84	11,33	10,03
IBH - Thesaurierend	EUR	11,30	10,84	9,65
UBH - Thesaurierend	EUR	11,67	11,17	9,90

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
DB - Thesaurierend	USD	6.974.356,138	1.240.648,978	7.065.610,061	1.331.902,901
EB - Thesaurierend	USD	155.620,446	161.709,446	4.500,000	10.589,000
IB - Thesaurierend	USD	1.000,000	1.000,000	0,000	0,000
UB - Thesaurierend	USD	0,000	98.000,000	0,000	98.000,000
EBH - Thesaurierend	CHF	834.488,280	816.333,043	21.485,259	3.330,022
UBH - Thesaurierend	CHF	119.348,589	133.132,000	9.216,589	23.000,000
EBH - Thesaurierend	EUR	186.285,000	252.280,000	4.125,000	70.120,000
IBH - Thesaurierend	EUR	27.000,000	27.000,000	0,000	0,000
UBH - Thesaurierend	EUR	61.155,320	66.755,320	0,000	5.600,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	33.739.529,28
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.731.267,41
Dividenden (Netto)	40.265,43
Bankzinsen	75.260,03
	2.846.792,87
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	97.752,31
Depotbank- und Depotgebühr	47.113,03
Zentralverwaltungsvergütung	9.566,78
Druck- und Veröffentlichungskosten	4.471,31
Zinsen und Bankspesen	1.212,44
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	50.208,93
"Taxe d'abonnement"	1.645,13
	211.969,93
Nettoerträge (-verluste)	2.634.822,94
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-155.467,02
Risikoprämie auf Cat-Bonds	3.420.556,92
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-594.673,08
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	181.759,06
	2.852.175,88
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	5.486.998,82
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-803.002,74
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-268.616,08
	-1.071.618,82
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	4.415.380,00
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	83.171.461,91
Rücknahmen	-18.910.911,86
	64.260.550,05
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	102.415.459,33

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Bermudas	71,02
Kaimaninseln	10,44
Singapur	7,12
Irland	5,74
Vereinigte Staaten	1,46
Supranational	0,99
Hongkong	0,73
Total	97,50

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	51,37
Versicherungsgesellschaften	33,04
Immobilien	8,13
Anlagefonds	1,95
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	1,67
Supranationale Organisationen	0,99
Verkehr und Transport	0,35
Total	97,50

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Cat Bonds			
USD 3264 RE LTD S 2022-1 144A FRN/21-080125	500.000	392.410,11	0,38
USD ACORN RE LTD 144A FRN/23-070527	1.000.000	998.122,49	0,97
USD ALAMO RE LTD 144A FRN/21-070624	1.750.000	1.744.251,62	1,70
USD ALAMO RE LTD 144A FRN/24-070627	500.000	494.381,88	0,48
USD ALAMO RE LTD 144A FRN/24-070627	1.000.000	987.882,53	0,96
USD ALAMO RE LTD S 2022-1 FRN/22-090625	500.000	490.779,66	0,48
USD ALAMO RE LTD S A 144A FRN/23-070626	250.000	249.234,47	0,24
USD AQUILA RE LTD 2023-1 144A FRN/23-080626	750.000	758.066,80	0,74
USD AQUILA RE LTD 2023-1 FRN/23-080626	500.000	504.154,01	0,49
USD AQUILA RE LTD 2023-1 FRN/23-080626	250.000	250.233,47	0,24
USD ARAGONITE RE LTD 144A FRN/24-070427	500.000	494.619,85	0,48
USD ASHERA RE S A 144A FRN/24-070427	1.000.000	941.375,35	0,92
USD ATLAS CAP RE 2022 FRN/22-060628	250.000	241.556,38	0,24
USD ATLAS CAPITAL DAC S A 144A FRN/23-050626	1.000.000	957.761,30	0,94
USD BALDWIN RE LTD 23-1 144A FRN/23-070627	750.000	746.834,42	0,72
USD BLACK KITE RE LTD 144A FRN/22-090625	750.000	746.816,05	0,73
USD BONANZA RE LTD 144A FRN/23-080126	250.000	249.734,46	0,24
USD BOWLINE RE 2018 144A FRN/22-230525	250.000	241.201,10	0,24
USD CAELUS RE V 2017-1 B 144A FRN 17-050624	75.000	67.345,33	0,07
USD CAELUS RE V 2017-1 C 144A FRN 17-050624	53.925	21.780,31	0,02
USD CAELUS RE VI LTD 144A FRN/20-070624	1.250.000	1.247.245,96	1,22
USD CAPE LOOKOUT RE LTD S A FRN/24-050427	750.000	736.509,11	0,72
USD CLAVEAU RE LTD S 2021-1 144A FRN/21-080125	583.482	356.766,99	0,35
USD EASTON RE PTE LTD 144A FRN/23-080127	250.000	242.221,60	0,24
EUR EIFFEL RE LTD 144A FRN/23-190127	250.000	269.808,14	0,26
USD FIRST COAST RE III PTE 144A FRN/21-070425	1.600.000	1.534.079,95	1,50
USD FIRST COAST RE IV LTD S A FRN/23-070426	250.000	248.472,04	0,24
USD FLOODSMART RE LTD 144A FRN/23-110326	1.250.000	1.242.836,40	1,21
USD FLOODSMART RE LTD S 2022-1 FRN/22-250225	4.000.000	3.884.228,36	3,79
USD FLOODSMART S 2022-1 144A FRN/22-250225	500.000	482.698,79	0,47
USD GATEWAY RE II LTD S 1 144A FRN/23-070426	1.000.000	1.009.376,41	0,98
USD GATEWAY RE LTD 144A FRN/23-240226	1.500.000	1.530.997,44	1,49
USD GATEWAY RE LTD 144A FRN/23-240226	2.750.000	2.766.632,91	2,70
USD HERBIE RE LTD 144A FRN/20-080126	250.000	238.189,60	0,23
USD HERBIE RE LTD 144A FRN/20-080126	186.657	99.955,88	0,10
USD HERBIE RE LTD -144A- FRN/20-26.01.2025	500.000	480.963,31	0,47
USD HERBIE RE LTD S 2021-1 144A FRN/21-060625	433.650	310.495,45	0,30
USD HESTIA S 2022-1 144A FRN/22-220425	1.000.000	949.501,38	0,93
EUR HEXAGON II 144A FRN/21-150126	1.250.000	1.309.147,39	1,28
EUR HEXAGON IV RE LTD 144A FRN/23-070131	250.000	274.561,85	0,27
USD HYPATIA LTD 144A FRN/23-080426	500.000	503.712,75	0,49
USD INTEGRITY RE LTD 144A FRN/23-060625	500.000	509.308,43	0,50
USD INTL BK RECON & DEVELOP 144A FRN/23-310326	1.000.000	1.009.635,32	0,99
USD KILIMANJARO III RE 144A FRN/19-080127	699.300	631.745,79	0,62
USD KILIMANJARO III RE 144A FRN/19-191224	699.300	623.595,27	0,61
USD KILIMANJARO III RE LTD 144a frn/21-210425	1.000.000	941.779,50	0,92
USD KILIMANJARO III RE LTD S 21-200426 144a FRN	750.000	685.110,82	0,67
USD LIGHTNING RE SERIE 23 144A FRN/23-310326	1.500.000	1.494.622,77	1,46
USD LOCKE TAVERN RE LTD 144A FRN/23-090426	250.000	249.374,85	0,24
USD LOWER FERRY RE LTD 144A FRN/23-080726	1.000.000	999.986,60	0,98
USD LOWER FERRY S 2023-1 144A FRN/23-080726	250.000	250.388,06	0,24
USD MANATEE RE III PTE LTD S. -2019-1-144A-FRN/19-08.06.2026	83.295	5.339,23	0,01
USD MATTERHORN RE LTD 144A FRN/21-071225	2.250.000	1.979.645,74	1,93
USD MATTERHORN RE LTD 144A FRN/22-070624	250.000	245.442,18	0,24
USD MAYFLOWER RE LTD 144A FRN/23-080726	250.000	252.921,61	0,25
USD MERNA REINS II S 2022-1 144A FRN/22-080430	250.000	250.142,18	0,24
USD MERNA REINS S 2022-2 FRN/22-070725	250.000	246.151,10	0,24
USD MERNA REINSURANCE II LTD 144A FRN/21-080724	750.000	747.269,62	0,73
USD MERNA REINSURANCE II LTD FRN/23-070726	750.000	764.877,34	0,75
USD MERNA REINSURANCE II LTF FRN/23-070726	500.000	506.367,48	0,49
USD MONA LISA RE LTD 144A FRN/21-080725	750.000	718.440,93	0,70
USD MONTOYA RE LTD 144A FRN/22-070426	1.000.000	1.044.288,36	1,02
USD MONTOYA RE LTD 144A FRN/24-070427	1.000.000	951.693,95	0,93
USD MYSTIC RE IV LTD 144A FRN/21-080125	2.000.000	1.955.842,94	1,91
USD MYSTIC RE IV LTD 144A FRN/23-080127	500.000	486.796,19	0,48
USD MYSTIC RE IV LTD S 2021-2 144A FRN/21-080125	1.000.000	981.009,75	0,96
USD NAKAMA RE LTD 144A FRN/23-090528	500.000	508.480,81	0,50
USD NAKAMA RE LTD 144A FRN/23-090528	250.000	248.337,56	0,24
USD NORTHSHORE RE II LTD S 2022-1 144A FRN/2	250.000	246.636,14	0,24
USD PURPLE RE LTD 144A FRN/23-050626	500.000	501.386,07	0,49
USD PURPLE RE LTD 2023-1 144A FRN/23-240426	1.500.000	1.516.165,04	1,48
USD QUEEN STREET 23 RE DAC A FRN/23-081225	2.750.000	2.683.081,80	2,62
USD RESIDENTIAL RE 2022 FRN/22-061226	750.000	745.177,67	0,73
USD RESIDENTIAL RE 2022 LTD 144A FRN/22-0612	1.250.000	1.260.842,03	1,23
USD RESIDENTIAL RE 2023 FRN/23-060627	750.000	734.555,51	0,72
USD RESIDENTIAL RE 2023 FRN/23-061224	1.000.000	907.368,80	0,89
USD RESIDENTIAL RE 2023 LTD 144A FRN/23-060627	1.000.000	967.337,65	0,94
USD RESIDENTIAL RE 21 S 2021-II 144A FRN/21-061225	3.250.000	3.061.399,84	2,99
USD RESIDENTIAL RE 21S 2021-II FRN/061225	1.250.000	1.183.801,15	1,16
USD SAKURA RE S 2021-1 144A FRN/21-070425	1.000.000	985.966,15	0,96
USD SANDERS RE II LTD 144A FRN/21-070425	1.000.000	965.561,51	0,94
USD SANDERS RE III LTD S A 144A FRN/22-070426	1.500.000	1.440.017,45	1,41
USD SANDERS RE III LTD S A 144A FRN/23-070427	250.000	245.907,24	0,24
USD SANDERS RE LTD 144A FRN/21-070425	1.000.000	975.363,16	0,95
USD SOLOMON RE 144A FRN/23-080626	500.000	493.961,10	0,48
USD STABILITAS RE LTD 144A FRN/23-050626	1.250.000	1.215.146,44	1,19
USD SUTTER RE LTD 144A FRN/23-190626	500.000	504.518,50	0,49

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 TAILWIND RE LTD 144A FRN/22-080125	750.000	705.083,33	0,69
USD TAILWIND RE LTD S CL 144A FRN/22-080125	250.000	236.482,93	0,23
USD TAILWIND RE LTD S CL 144A FRN/22-080125	3.250.000	3.074.924,45	3,00
USD TAILWIND S CL 144A FRN/22-080125	750.000	704.809,79	0,69
USD TITANIA RE LTD S 2021-2 FRN/21-271224	250.000	233.986,06	0,23
USD TOMONI RE PTE LTD 144A FRN/24-050428	500.000	496.850,11	0,49
USD TOMONI RE PTE LTD 144A FRN/24-050428	500.000	495.013,19	0,48
USD TORREY PINES RE LTD 2023-1 FRN/23-050626	500.000	502.649,87	0,49
USD TORREY PINES RE LTD 2023-1 FRN/23-050626	500.000	499.136,45	0,49
USD TORREY PINES RE LTD S 2022-1 144A FRN/22	500.000	494.285,41	0,48
NZD TOTARA RE PTE LTD 144A FRN/23-080627	2.000.000	1.237.603,80	1,21
USD UMIGAME 3C7 144A FRN/21-040725	1.500.000	1.485.638,69	1,45
USD UMIGAME RE L S 2021-1 144A FRN/21-070425	1.000.000	986.293,24	0,96
USD UMIGAME RE L S 2021-1 144A FRN/21-070425	500.000	494.720,74	0,48
USD URSA RE II LTD 144A FRN/22-160625	750.000	742.808,24	0,73
USD URSA RE II S 2021-1 144A FRN/21-061224	2.000.000	1.959.433,02	1,91
USD URSA RE LTD 144A FRN/23-061225	750.000	762.957,07	0,74
USD URSA RE LTD 144A FRN/23-061225	1.000.000	1.002.194,94	0,98
USD URSA RE LTD 144A FRN/23-071226	2.000.000	2.007.579,80	1,96
USD VERAISON RE LTD 144A FRN/24-080327	500.000	496.681,39	0,48
USD VERAISON RE LTD FRN/22-090326	750.000	786.808,99	0,77
USD VISTA RE LTD 144A FRN/22-210525	250.000	242.321,44	0,24
USD VITA CAPITAL VI LTD 144A FRN/21-080126	2.000.000	0,00	0,00
USD VITALITY RE XIII LTD 144A FRN/22-060126	250.000	247.678,46	0,24
EUR WINDMILL II RE LTD 144A FRN/20-050724	1.750.000	1.696.130,75	1,65
Total Cat Bonds		93.004.823,09	90,81
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		93.004.823,09	90,81
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Cat Bonds			
USD BONANZA S 2022 144A FRN/22-160325	1.000.000	899.225,00	0,88
USD EDEN RE II LTD 144A 0%/20-210325	57.593	18.559,38	0,02
USD EDEN RE II LTD 144A 0%/20-210325	59.691	15.860,02	0,02
USD FISH POND RE LTD S 2024-1 FRN/24-080131	250.000	247.084,41	0,24
USD FOUR LAKES RE LTD 144A FRN/22-070126	250.000	248.753,69	0,24
USD GATEWAY RE LTD 144A FRN/22-120525	750.000	747.271,34	0,73
EUR HEXAGON IV RE LTD 144A FRN/23-080129	1.500.000	1.665.772,01	1,63
USD SAKURA RE LTD S 22-1 144A FRN/22-050126	500.000	514.470,99	0,50
USD SANDERS RE III LTD 144A FRN/24-070428	500.000	492.520,01	0,48
Total Cat Bonds		4.849.516,85	4,74
Nicht börsennotierte Wertpapiere		4.849.516,85	4,74
Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD GOLDMAN SACHS - USD TREASURY LIQ RES FD	2.000.000	2.000.000,00	1,95
Total Fondsanteile (Open-End)		2.000.000,00	1,95
Total Investmentfonds		2.000.000,00	1,95
Total des Wertpapierbestandes		99.854.339,94	97,50
Bareinlagen bei Banken und Brokern		564.356,05	0,55
Andere Nettvermögenswerte		1.996.763,34	1,95
Teilfondsvermögen		102.415.459,33	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
B - Thesaurierend	EUR	22634836	LU0984159805	1,50%	2,11%
IB - Thesaurierend	EUR	24027190	LU1048951070	0,60%	1,21%
UB - Thesaurierend	EUR	26366653	LU1144420467	1,25%	1,86%
BH - Thesaurierend	CHF	22634841	LU0984159987	1,50%	2,19%
UBH - Thesaurierend	CHF	26366667	LU1144420541	1,25%	1,94%
BH - Thesaurierend	GBP	22634850	LU0984160134	1,50%	2,19%
UBH - Thesaurierend	GBP	26366728	LU1144420624	1,25%	1,94%
BH - Thesaurierend	USD	22634846	LU0984160050	1,50%	2,19%
UBH - Thesaurierend	USD	26367307	LU1144420897	1,25%	1,94%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	EUR	4,43%	/	8,88%	-12,39%	12,81%
IB - Thesaurierend	EUR	4,83%	/	9,85%	-11,60%	13,83%
UB - Thesaurierend	EUR	4,55%	/	9,14%	-12,18%	13,10%
BH - Thesaurierend	CHF	3,41%	/	6,58%	-12,98%	12,47%
UBH - Thesaurierend	CHF	3,51%	/	6,85%	-12,75%	12,72%
BH - Thesaurierend	GBP	4,92%	/	10,30%	-11,40%	13,29%
UBH - Thesaurierend	GBP	5,03%	/	10,57%	-11,18%	13,57%
BH - Thesaurierend	USD	5,01%	/	11,30%	-10,73%	13,62%
UBH - Thesaurierend	USD	5,12%	/	11,59%	-10,49%	13,88%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In EUR)
EUR	1.290	USD	-1.400	11.06.2024	1,01
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	155.400	EUR	-143.026	11.06.2024	55,57
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	200	EUR	-203	11.06.2024	1,52
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	3.923.600	EUR	-4.551.714	11.06.2024	48.100,33
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	13.784	CHF	-13.500	11.06.2024	-11,10
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	300	EUR	-306	11.06.2024	0,16
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.383	USD	-1.500	11.06.2024	1,80
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	300	EUR	-306	11.06.2024	0,88
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	16.796.200	EUR	-15.613.755	11.06.2024	-148.979,13
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	237.554	CHF	-234.400	11.06.2024	-1.971,80
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	400	EUR	-404	11.06.2024	4,39
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	23.500	EUR	-27.563	11.06.2024	-13,17
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	24.000	EUR	-24.249	11.06.2024	276,04
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	12.689	CHF	-12.500	11.06.2024	-84,77
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In EUR)
CHF	12.938.700	EUR	-13.272.770	11.06.2024	-51.046,09
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	3.522.037	GBP	-3.000.000	14.06.2024	5.448,80
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	24.654.752	USD	-26.530.000	14.06.2024	231.392,66
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
GBP	1.500.000	EUR	-1.739.518	14.06.2024	18.777,67
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	3.947.100	EUR	-4.626.969	25.06.2024	-2.337,62
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	16.951.600	EUR	-15.591.994	25.06.2024	5.523,41
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	12.950.700	EUR	-13.097.311	25.06.2024	148.993,23
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					254.133,79

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

		31.05.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		266.192.335,08			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		7.055.456,79			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		254.133,79			
Andere Aktiva		1.940,24			
		273.503.865,90			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		228.123,15			
		397.871,09			
		625.994,24			
Nettovermögen		272.877.871,66			
Teilfondsentwicklung		31.05.2024	30.11.2023	30.11.2022	
Teilfondsvermögen	EUR	272.877.871,66	271.503.784,84	317.499.581,94	
Nettoinventarwert pro Aktie					
B - Thesaurierend	EUR	150,79	140,49	136,95	
IB - Thesaurierend	EUR	1.608,82	1.492,23	1.441,56	
UB - Thesaurierend	EUR	132,92	123,69	120,27	
BH - Thesaurierend	CHF	138,63	130,78	130,08	
UBH - Thesaurierend	CHF	122,87	115,77	114,86	
BH - Thesaurierend	GBP	161,21	149,38	143,68	
UBH - Thesaurierend	GBP	142,24	131,64	126,30	
BH - Thesaurierend	USD	174,05	161,03	153,53	
UBH - Thesaurierend	USD	153,90	142,20	135,24	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	EUR	1.038.419,269	1.093.596,605	5.703,750	60.881,086
IB - Thesaurierend	EUR	5.839,601	5.839,601	0,000	0,000
UB - Thesaurierend	EUR	304.172,365	323.946,615	6.891,018	26.665,268
BH - Thesaurierend	CHF	154.049,267	163.141,952	589,487	9.682,172
UBH - Thesaurierend	CHF	34.064,047	35.727,654	0,000	1.663,607
BH - Thesaurierend	GBP	22.877,811	24.471,711	52,936	1.646,836
UBH - Thesaurierend	GBP	29.433,668	33.393,188	2.580,637	6.540,157
BH - Thesaurierend	USD	167.499,952	171.756,471	2.309,894	6.566,413
UBH - Thesaurierend	USD	30.319,557	57.849,157	0,000	27.529,600

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in EUR)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	271.503.784,84
Erträge	
Dividenden (Netto)	394.141,24
Bankzinsen	92.212,97
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	11.618,11
	497.972,32
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.958.998,55
Depotbank- und Depotgebühr	86.298,07
Zentralverwaltungsvergütung	82.841,56
Druck- und Veröffentlichungskosten	4.973,94
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	107.211,25
"Taxe d'abonnement"	19.742,20
	2.260.065,57
Nettoerträge (-verluste)	-1.762.093,25
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	1.856.523,54
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-751.462,11
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	175.830,46
	1.280.891,89
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-481.201,36
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	19.693.665,81
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-264.675,19
	19.428.990,62
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	18.947.789,26
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	2.604.993,53
Rücknahmen	-20.178.695,97
	-17.573.702,44
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	272.877.871,66

Aufstellung des Wertpapierbestandes**Geographische Aufteilung**

Luxemburg	72,13
Irland	25,42
Total	97,55

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	97,55
Total	97,55

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
EUR BLACKROCK GLOB FD - EUR SHORT DUR BD I2	609.000	9.957.150,00	3,65
EUR BLACKROCK GLOBAL - EURO BOND FD I2	1.012.000	13.702.480,00	5,02
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND - EB- USD	17.200	13.591.897,57	4,98
EUR CREDIT SUISSE (LUX) CORP SHORT DURA EUR BD FD EB	12.700	13.523.849,00	4,96
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND EBH EUR	6.900	7.367.544,00	2,70
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD - OBX USD- USD	8.500	7.634.262,16	2,80
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE - OBX- JPY	8.100	9.347.329,90	3,43
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND - EA- USD	7.460	6.938.157,33	2,54
EUR CSIF (LUX) BOND AGGREGATE EUR OBX EUR	20.200	17.656.012,00	6,47
USD CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MKRKS OBX USD	4.200	4.363.109,80	1,60
EUR CSIF (LUX) EQUITY EMU OBX EUR	3.900	5.804.799,00	2,13
EUR DB X-TRACKERS - DJ EURO STOXX 50 ETF -IC-	306.000	25.691.760,00	9,42
EUR FIDELITY EUROPEAN DYNAMIC GROWTH FUND Y	150.000	4.878.000,00	1,79
USD FIDELITY FUNDS SICAV EMER ASIA FUND	284.000	10.799.115,70	3,96
USD INVESCO EOCQ NASDAQ 100 UCITS ETF	42.000	17.316.875,46	6,35
EUR ISHARES CORE EUR GOVT BOND UCI	68.000	7.422.138,80	2,72
USD ISHARES DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE UCITS ETF USD CAP	22.800	9.661.170,27	3,54
EUR ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	25.000	1.470.432,50	0,54
EUR JUPITER GLOBAL FD - EUROPEAN GROWTH I	46.000	3.119.720,00	1,14
USD NOMURA FUNDS IRELAND - US HIGH YIELD BOND FUND -I- USD	2.000	697.515,84	0,26
EUR PAN EUROPEAN PROPERTY EQUITIES FD G2 EUR	180.000	7.506.000,00	2,75
EUR PICTET SICAV SHORT TERM MONEY MARKET EUR -I-	5.000	717.630,00	0,26
USD REYL GLOBAL FUND - EMERGING MKTS EQU IP	40.100	9.568.445,10	3,51
USD ROBECO CAP GROW HIGH YIELD USD IH	15.000	4.862.288,14	1,78
EUR SCHRODER INTERNATIONAL SELECTION FUND SICAV - EURO CORPORATE BOND -C-	600.000	15.090.300,00	5,53
GBP SPDR FTSE UK ALL SHARES ETF GBP	82.700	6.560.520,73	2,40
CHF SSGA STATE STREET SWITZERLAND IDX EQ I	175.000	2.945.552,42	1,08
EUR STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG	120.000	1.760.326,00	0,65
USD VANGUARD FUND PLC - S&P 500 EXCHANGE TRADED FUND	288.000	26.237.951,36	9,62
Total Fondsanteile (Open-End)		266.192.335,08	97,55
Total Investmentfonds		266.192.335,08	97,55
Total des Wertpapierbestandes		266.192.335,08	97,55
Bareinlagen bei Banken und Brokern		7.055.456,79	2,59
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-228.123,15	-0,08
Andere Passiva		-141.797,06	-0,06
Teilfondsvermögen		272.877.871,66	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	EUR	22635922	LU0984160217	1,30%	1,91%
IB - Thesaurierend	EUR	24027192	LU1048951153	0,60%	1,20%
UB - Thesaurierend	EUR	26368451	LU1144420970	1,05%	1,65%
BH - Thesaurierend	CHF	22635925	LU0984160308	1,30%	1,99%
UBH - Thesaurierend	CHF	26368560	LU1144421192	1,05%	1,74%
BH - Thesaurierend	GBP	22635938	LU0984160563	1,30%	1,99%
UBH - Thesaurierend	GBP	26369262	LU1144421275	1,05%	1,73%
BH - Thesaurierend	USD	22635930	LU0984160480	1,30%	1,99%
UBH - Thesaurierend	USD	26369836	LU1144421358	1,05%	1,74%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	EUR	2,68%	/	6,81%	-12,06%	7,72%
IB - Thesaurierend	EUR	2,98%	/	7,56%	-11,44%	8,49%
UB - Thesaurierend	EUR	2,79%	/	7,07%	-11,83%	8,00%
BH - Thesaurierend	CHF	1,65%	/	4,54%	-12,56%	7,39%
UBH - Thesaurierend	CHF	1,76%	/	4,80%	-12,35%	7,64%
BH - Thesaurierend	GBP	3,16%	/	8,20%	-11,04%	8,24%
UBH - Thesaurierend	GBP	3,27%	/	8,47%	-10,82%	8,52%
BH - Thesaurierend	USD	3,25%	/	9,10%	-10,28%	8,49%
UBH - Thesaurierend	USD	3,35%	/	9,38%	-10,05%	8,76%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In EUR)
USD	15.928.900	EUR	-14.807.512	11.06.2024	-141.286,35
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	10.492	CHF	-10.400	11.06.2024	-135,62
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	106.751	CHF	-105.800	11.06.2024	-1.362,10
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.328	CHF	-1.300	11.06.2024	-0,69
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	40.437	USD	-43.800	11.06.2024	108,94
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	80.668	USD	-87.500	11.06.2024	104,48
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	2.291.600	EUR	-2.658.453	11.06.2024	28.093,26
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	10.000	EUR	-10.134	11.06.2024	85,01
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	21.834	CHF	-21.600	11.06.2024	-238,64
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	338.900	EUR	-311.914	11.06.2024	121,20
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	53.600	EUR	-62.868	11.06.2024	-30,03
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	363.100	EUR	-366.866	11.06.2024	4.176,29
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	17.259.200	EUR	-17.704.823	11.06.2024	-68.091,44
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
GBP	1.650.000	EUR	-1.913.469	14.06.2024	20.655,45
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In EUR)
EUR	38.362.162	USD	-41.280.000	14.06.2024	360.041,06
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	3.991.642	GBP	-3.400.000	14.06.2024	6.175,30
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	16.267.800	EUR	-14.963.038	25.06.2024	5.300,60
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	17.622.400	EUR	-17.821.898	25.06.2024	202.739,49
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	2.345.200	EUR	-2.749.150	25.06.2024	-1.388,91
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					415.067,30

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

		31.05.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		296.537.300,84			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		9.863.285,09			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		415.067,30			
		306.815.653,23			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		391.381,70			
Andere Passiva		82,61			
		391.464,31			
Nettovermögen		306.424.188,92			
Teilfondsentwicklung		31.05.2024	30.11.2023	30.11.2022	
Teilfondsvermögen	EUR	306.424.188,92	317.660.275,63	406.819.709,63	
Nettoinventarwert pro Aktie					
B - Thesaurierend	EUR	130,32	123,69	121,68	
IB - Thesaurierend	EUR	1.331,09	1.258,91	1.229,87	
UB - Thesaurierend	EUR	117,28	111,17	109,10	
BH - Thesaurierend	CHF	119,63	114,98	115,45	
UBH - Thesaurierend	CHF	108,50	104,15	104,31	
BH - Thesaurierend	GBP	140,08	132,23	128,37	
UBH - Thesaurierend	GBP	126,01	118,80	115,04	
BH - Thesaurierend	USD	151,17	142,48	137,16	
UBH - Thesaurierend	USD	136,19	128,20	123,10	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	EUR	1.360.317,789	1.554.185,499	4.150,707	198.018,417
IB - Thesaurierend	EUR	9.630,130	4.704,000	4.926,130	0,000
UB - Thesaurierend	EUR	387.046,500	407.305,612	3.251,641	23.510,753
BH - Thesaurierend	CHF	208.417,131	224.911,066	83,291	16.577,226
UBH - Thesaurierend	CHF	92.199,855	98.335,097	2.225,509	8.360,751
BH - Thesaurierend	GBP	29.100,304	32.127,928	0,000	3.027,624
UBH - Thesaurierend	GBP	4.772,643	8.130,968	0,000	3.358,325
BH - Thesaurierend	USD	173.472,821	189.989,685	0,000	16.516,864
UBH - Thesaurierend	USD	44.788,152	45.227,023	0,000	438,871

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in EUR)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	317.660.275,63
Erträge	
Dividenden (Netto)	443.446,23
Bankzinsen	97.555,69
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	15.187,34
	556.189,26
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.936.295,79
Depotbank- und Depotgebühr	98.531,38
Zentralverwaltungsvergütung	94.584,99
Druck- und Veröffentlichungskosten	5.013,99
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	116.133,93
"Taxe d'abonnement"	17.277,90
	2.267.837,98
Nettoerträge (-verluste)	-1.711.648,72
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	1.625.743,61
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.285.211,83
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	340.791,13
	681.322,91
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.030.325,81
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	17.101.909,32
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-542.714,51
	16.559.194,81
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	15.528.869,00
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	7.560.046,04
Rücknahmen	-34.325.001,75
	-26.764.955,71
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	306.424.188,92

Aufstellung des Wertpapierbestandes**Geographische Aufteilung**

Luxemburg	78,20
Irland	18,57
Total	96,77

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	96,77
Total	96,77

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
EUR BLACKROCK GLOB FD - EUR SHORT DUR BD I2	1.531.738	25.043.916,30	8,17
EUR BLACKROCK GLOBAL - EURO BOND FD I2	2.041.000	27.635.140,00	9,02
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND - EB- USD	19.170	15.148.643,98	4,94
EUR CREDIT SUISSE (LUX) CORP SHORT DURA EUR BD FD EB	20.900	22.255.783,00	7,26
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND EBH EUR	9.450	10.090.332,00	3,29
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD - OBX USD- USD	18.600	16.705.561,90	5,45
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE - OBX- JPY	4.200	4.846.763,65	1,58
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND - EA- USD	8.320	7.737.998,53	2,53
EUR CSIF (LUX) BOND AGGREGATE EUR OBX EUR	22.200	19.404.132,00	6,33
USD CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MKRKS OBX USD	6.126	6.363.907,30	2,08
EUR CSIF (LUX) EQUITY EMU OBX EUR	2.700	4.018.707,00	1,31
EUR DB X-TRACKERS - DJ EURO STOXX 50 ETF -IC-	200.700	16.850.772,00	5,50
EUR FIDELITY EUROPEAN DYNAMIC GROWTH FUND Y	100.000	3.252.000,00	1,06
USD FIDELITY FUNDS SICAV EMER ASIA FUND	160.000	6.084.008,84	1,99
USD INVESCO EOCQ NASDAQ 100 UCITS ETF	30.100	12.410.427,41	4,05
EUR ISHARES CORE EUR GOVT BOND UCI	128.000	13.971.084,80	4,56
USD ISHARES DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE UCITS ETF USD CAP	12.800	5.423.814,89	1,77
EUR ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	17.100	1.005.775,83	0,33
EUR JUPITER GLOBAL FD - EUROPEAN GROWTH I	33.901	2.299.165,82	0,75
USD NOMURA FUNDS IRELAND - US HIGH YIELD BOND FUND -I- USD	5.500	1.918.168,57	0,63
EUR PAN EUROPEAN PROPERTY EQUITIES FD G2 EUR	215.000	8.965.500,00	2,93
EUR PICTET SICAV SHORT TERM MONEY MARKET EUR -I-	10.000	1.435.260,00	0,47
USD REYL GLOBAL FUND - EMERGING MKTS EQU IP	25.700	6.132.394,99	2,00
USD ROBECO CAP GROW HIGH YIELD USD IH	25.000	8.103.813,56	2,64
EUR SCHRODER INTERNATIONAL SELECTION FUND SICAV - EURO CORPORATE BOND -C-	916.000	23.037.658,00	7,52
GBP SPDR FTSE UK ALL SHARES ETF GBP	57.500	4.561.426,14	1,49
CHF SSGA STATE STREET SWITZERLAND IDX EQ I	111.000	1.868.327,16	0,61
EUR STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG	160.000	2.347.104,00	0,77
USD VANGUARD FUND PLC - S&P 500 EXCHANGE TRADED FUND	193.400	17.619.513,17	5,75
Total Fondsanteile (Open-End)		296.537.300,84	96,77
Total Investmentfonds		296.537.300,84	96,77
Total des Wertpapierbestandes		296.537.300,84	96,77
Bareinlagen bei Banken und Brokern		9.863.285,09	3,22
Andere Nettovermögenswerte		23.602,99	0,01
Teilfondsvermögen		306.424.188,92	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	25142035	LU1097743329	1,10%	1,35%
B - Thesaurierend	USD	25142036	LU1097743592	1,10%	1,35%
IA - Ausschüttend	USD	25142037	LU1097743758	0,50%	0,75%
IB - Thesaurierend	USD	56652757	LU1577415604	0,50%	0,75%
UA - Ausschüttend	USD	26358924	LU1144419535	0,90%	1,15%
UB - Thesaurierend	USD	27227823	LU1195447187	0,90%	1,15%
AH - Ausschüttend	CHF	25407883	LU1109643400	1,10%	1,43%
BH - Thesaurierend	CHF	25508532	LU1114186320	1,10%	1,43%
IAH - Ausschüttend	CHF	49002215	LU2029718652	0,50%	0,83%
UAH - Ausschüttend	CHF	26362606	LU1144419618	0,90%	1,23%
UBH - Thesaurierend	CHF	27227824	LU1195451379	0,90%	1,23%
AH - Ausschüttend	EUR	25407890	LU1109644804	1,10%	1,43%
BH - Thesaurierend	EUR	25508534	LU1114186759	1,10%	1,43%
UAH - Ausschüttend	EUR	26362608	LU1144419709	0,90%	1,23%
UBH - Thesaurierend	EUR	26362609	LU1144419881	0,90%	1,23%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	USD	3,17%	/	9,52%	-6,33%	6,73%
B - Thesaurierend	USD	3,17%	/	9,53%	-6,33%	6,72%
IA - Ausschüttend	USD	3,43%	/	10,18%	-5,77%	7,37%
IB - Thesaurierend	USD	3,43%	55,35%	10,18%	-5,77%	/
UA - Ausschüttend	USD	3,26%	/	9,75%	-6,15%	6,94%
UB - Thesaurierend	USD	3,26%	/	9,74%	-6,15%	6,94%
AH - Ausschüttend	CHF	1,39%	/	4,86%	-8,98%	5,44%
BH - Thesaurierend	CHF	1,38%	/	4,87%	-8,93%	5,47%
IAH - Ausschüttend	CHF	1,64%	/	5,50%	-8,44%	6,04%
UAH - Ausschüttend	CHF	1,47%	/	5,07%	-8,79%	5,62%
UBH - Thesaurierend	CHF	1,47%	/	5,08%	-8,75%	5,68%
AH - Ausschüttend	EUR	2,40%	/	6,95%	-8,61%	5,61%
BH - Thesaurierend	EUR	2,43%	/	6,95%	-8,57%	5,70%
UAH - Ausschüttend	EUR	2,50%	/	7,17%	-8,46%	5,81%
UBH - Thesaurierend	EUR	2,49%	/	7,17%	-8,39%	5,96%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	14.12.2023	1,45
A - Ausschüttend	USD	15.03.2024	1,50
IA - Ausschüttend	USD	14.12.2023	16,40
IA - Ausschüttend	USD	15.03.2024	17,20
UA - Ausschüttend	USD	14.12.2023	1,50
UA - Ausschüttend	USD	15.03.2024	1,55
AH - Ausschüttend	CHF	14.12.2023	1,20
AH - Ausschüttend	CHF	15.03.2024	1,20
IAH - Ausschüttend	CHF	14.12.2023	15,45
IAH - Ausschüttend	CHF	15.03.2024	15,50
UAH - Ausschüttend	CHF	14.12.2023	1,25
UAH - Ausschüttend	CHF	15.03.2024	1,25
AH - Ausschüttend	EUR	14.12.2023	1,20
AH - Ausschüttend	EUR	15.03.2024	1,25
UAH - Ausschüttend	EUR	14.12.2023	1,30
UAH - Ausschüttend	EUR	15.03.2024	1,30

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In USD)
CHF	700	USD	-770	11.06.2024	6,87
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	101.798	EUR	-93.700	11.06.2024	30,72
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	2.666.400	USD	-2.897.004	11.06.2024	-1.043,10
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	5.925.537	EUR	-5.452.500	11.06.2024	3.607,92
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	10.041.100	USD	-10.800.137	11.06.2024	105.441,59
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	650	EUR	-600	11.06.2024	-1,76
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	36.699	CHF	-33.300	11.06.2024	-258,94
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	21.212	CHF	-19.200	11.06.2024	-96,64
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	16.716.100	USD	-18.441.241	11.06.2024	111.139,06
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	23.495	CHF	-21.200	11.06.2024	-34,20
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	19.900	USD	-21.579	11.06.2024	34,45
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	200	USD	-219	11.06.2024	2,72
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	22.600	USD	-25.051	11.06.2024	31,86
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	7.255.000	USD	-7.887.415	25.06.2024	-2.579,15
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	16.241.000	USD	-17.859.224	25.06.2024	194.596,10
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	550.000	USD	-599.187	23.08.2024	254,65
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	5.706.048	AUD	-8.665.000	23.08.2024	-69.168,86
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	19.217.204	GBP	-15.395.438	23.08.2024	-392.915,54
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.877.094	MXN	-32.250.000	23.08.2024	10.716,75
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	901.703	SGD	-1.217.000	23.08.2024	-2.164,70
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	670.695	PLN	-2.700.000	23.08.2024	-14.327,89
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	6.533.674	CAD	-8.970.000	23.08.2024	-57.051,37
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.306.990	SEK	-14.200.000	23.08.2024	-48.690,20
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	4.631.912	NOK	-50.580.000	23.08.2024	-194.023,82
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	320.246	NZD	-535.000	23.08.2024	-8.388,23
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	21.855.769	EUR	-20.245.000	23.08.2024	-208.310,94
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.988.176	CHF	-1.785.000	23.08.2024	-9.402,04
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	6.329.333	JPY	-968.000.000	23.08.2024	89.980,32
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	8.295.806	HKD	-64.660.000	23.08.2024	13.480,82
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	2.281.383	ZAR	-42.770.000	23.08.2024	26.107,90
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	420.967	CZK	-9.800.000	23.08.2024	-10.146,59
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-463.172,24

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.05.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		192.211.602,94			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.069.875,26			
Forderungen aus Erträgen		2.276.946,42			
Andere Aktiva		405,61			
		196.558.830,23			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		223.547,88			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		463.172,24			
		686.720,12			
Nettovermögen		195.872.110,11			
Teilfondsentwicklung		31.05.2024	30.11.2023	30.11.2022	
Teilfondsvermögen	USD	195.872.110,11	221.817.971,82	271.963.986,05	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	119,17	114,28	114,14	
B - Thesaurierend	USD	197,04	184,24	174,59	
IA - Ausschüttend	USD	1.404,88	1.342,11	1.330,44	
IB - Thesaurierend	USD	1.377,67	1.284,28	1.209,76	
UA - Ausschüttend	USD	124,92	119,63	119,23	
UB - Thesaurierend	USD	199,12	186,00	175,91	
AH - Ausschüttend	CHF	92,24	90,46	94,48	
BH - Thesaurierend	CHF	153,37	146,54	145,02	
IAH - Ausschüttend	CHF	1.241,21	1.212,48	1.256,64	
UAH - Ausschüttend	CHF	96,61	94,65	98,67	
UBH - Thesaurierend	CHF	155,05	148,00	146,17	
AH - Ausschüttend	EUR	97,96	94,83	97,08	
BH - Thesaurierend	EUR	162,17	153,03	148,64	
UAH - Ausschüttend	EUR	103,22	99,84	102,09	
UBH - Thesaurierend	EUR	166,06	156,57	151,77	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	177.988,878	209.063,824	501,234	31.576,180
B - Thesaurierend	USD	241.726,062	268.990,573	1.776,583	29.041,094
IA - Ausschüttend	USD	8.902,535	12.333,665	493,196	3.924,326
IB - Thesaurierend	USD	11.767,281	12.329,162	0,000	561,881
UA - Ausschüttend	USD	103.310,212	138.778,044	1.507,476	36.975,308
UB - Thesaurierend	USD	164.983,169	174.725,331	227,143	9.969,305
AH - Ausschüttend	CHF	50.494,163	55.283,367	5.810,000	10.599,204
BH - Thesaurierend	CHF	1.794,754	2.084,706	31,633	321,585
IAH - Ausschüttend	CHF	1.714,179	1.779,179	0,000	65,000
UAH - Ausschüttend	CHF	252.671,090	301.280,026	5.340,237	53.949,173
UBH - Thesaurierend	CHF	10.859,097	11.229,012	575,000	944,915
AH - Ausschüttend	EUR	71.878,465	88.845,148	290,795	17.257,478
BH - Thesaurierend	EUR	8.648,400	45.044,257	0,000	36.395,857
UAH - Ausschüttend	EUR	51.366,456	55.447,977	593,796	4.675,317
UBH - Thesaurierend	EUR	4.877,810	4.890,451	187,359	200,000

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	221.817.971,82
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	3.057.430,43
Dividenden (Netto)	3.718.704,63
Bankzinsen	30.668,25
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	50.717,66
	6.857.520,97
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	973.599,80
Depotbank- und Depotgebühr	65.645,33
Zentralverwaltungsvergütung	63.027,23
Druck- und Veröffentlichungskosten	8.719,71
Zinsen und Bankspesen	101,07
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	104.936,24
"Taxe d'abonnement"	49.647,35
	1.265.676,73
Nettoerträge (-verluste)	5.591.844,24
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-2.123.768,85
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-2.279.450,83
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	401.420,52
	-4.001.799,16
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	1.590.045,08
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	10.154.488,08
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	83.126,93
	10.237.615,01
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	11.827.660,09
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	2.718.250,28
Rücknahmen	-37.759.763,72
	-35.041.513,44
Ausschüttung	-2.732.008,36
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	195.872.110,11

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	26,14
Grossbritannien	7,69
Luxemburg	4,28
Kanada	4,27
Australien	3,67
Niederlande	3,39
Japan	3,29
Frankreich	3,00
Irland	2,61
Deutschland	1,93
China	1,85
Kaimaninseln	1,84
Spanien	1,76
Belgien	1,41
Bermudas	1,38
Südkorea	1,35
Italien	1,33
Schweiz	1,27
Norwegen	1,18
Hongkong	1,12
Brasilien	1,11
Singapur	1,11
Malaysia	1,02
Supranational	1,00
Guernsey	0,99
Panama	0,98
Schweden	0,96
Peru	0,91
Finnland	0,90
Kolumbien	0,86
Mexiko	0,86
Südafrika	0,85
Philippinen	0,81
Thailand	0,80
Jersey	0,63
Oman	0,61
Uruguay	0,60
Costa Rica	0,49
Bahrain	0,47
Mauritius	0,46
Indonesien	0,45
Österreich	0,45
Oatar	0,45
Neuseeland	0,43
Polen	0,43
Tschechische Republik	0,41
Taiwan	0,40
Ungarn	0,38
Vereinigte Arabische Emirate	0,37
Argentinien	0,29
Dänemark	0,29
Britische Jungferninseln	0,26
Griechenland	0,26
Bahamas	0,25
Chile	0,25
Dominikanische Republik	0,25
Rumänien	0,18
Jamaika	0,17
Paraguay	0,15
Slowenien	0,15
Trinidad Und Tobago	0,15
Guatemala	0,11
Elfenbeinküste	0,10
Indien	0,10
Marokko	0,10
Papua-Neuguinea	0,10
Kamerun	0,07
Russland	0,00
Total	98,13

Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	12,63
Länder und Zentralregierungen	10,31

Anlagefonds	7,76
Banken und andere Kreditinstitute	6,61
Telekommunikation	5,90
Energie- und Wasserversorgung	4,87
Petroleum	4,60
Versicherungsgesellschaften	4,35
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	4,05
Verkehr und Transport	3,86
Tabak und alkoholische Getränke	3,00
Immobilien	3,00
Einzelhandel und Warenhäuser	3,00
Fahrzeuge	2,08
Elektronik und Halbleiter	1,99
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,89
Chemie	1,74
Elektrische Geräte und Komponenten	1,69
Supranationale Organisationen	1,58
Computerhardware und Netzwerk	1,58
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,54
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	1,38
Baustoffe und Bauindustrie	1,21
Maschinenbau und Industrieanlagen	1,14
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	1,01
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,80
Nichteisenmetalle	0,79
Diverse Dienstleistungen	0,64
Grafikverlags- und Druckmedien	0,51
Verschiedene Konsumgüter	0,47
Verschiedene Handelsunternehmen	0,38
Gummi und Reifen	0,36
Gesundheits- und Sozialdienste	0,36
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,28
Luft- und Raumfahrtindustrie	0,25
Landwirtschaft und Fischerei	0,20
Biotechnologie	0,13
Verpackungsindustrie	0,11
Edelmetalle und Edelsteine	0,10
Total	98,13

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

Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere							
Aktien							
USD				GBP			
USD				PHP			
USD				NOK			
EUR				PLN			
EUR				USD			
JPY				USD			
EUR				CAD			
EUR				EUR			
USD				EUR			
EUR				CAD			
EUR				EUR			
USD				EUR			
EUR				EUR			
USD				EUR			
EUR				CAD			
USD				ZAR			
HKD				EUR			
EUR				EUR			
NOK				EUR			
CAD				USD			
EUR				AUD			
USD				USD			
USD				EUR			
USD				USD			
USD				RUB			
USD				USD			
AUD				PHP			
USD				CAD			
GBP				EUR			
AUD				KRW			
USD				GBP			
USD				CAD			
USD				MVR			
TWD				EUR			
EUR				AUD			
EUR				USD			
JPY				JPY			
USD				AUD			
AUD				USD			
AUD				EUR			
AUD				HKD			
NOK				USD			
EUR				GBP			
EUR				HKD			
EUR				USD			
USD				GBP			
MXN				GBP			
HKD				USD			
CAD				USD			
CAD				USD			
USD				USD			
EUR				GBP			
EUR				CAD			
BRL				GBP			
CAD				GBP			
HKD				HKD			
CHF				KRW			
AUD				USD			
USD				GBP			
GBP				EUR			
EUR				USD			
EUR				USD			
GBP				AUD			
USD				BRL			
GBP				HKD			
MYR				USD			
USD				JPY			
USD				JPY			
GBP				EUR			
EUR				EUR			
CAD				CAD			
CAD				MXN			
CAD				HKD			
JPY				USD			
CAD				MYR			
SGD				EUR			
CHF				EUR			
CZK				USD			
HKD				ZAR			
HKD				EUR			
HKD				USD			
HKD				THB			
HKD				GBP			
HKD				GBP			
CAD				USD			
EUR				NOK			
USD				KRW			
HKD				HKD			
USD				USD			
HKD				RUB			
USD				USD			
HKD				GBP			
USD				EUR			
AUD				RUB			
CHF				HUF			
USD				MYR			
NZD				MYR			
EUR				CAD			
EUR				EUR			
AUD				SGD			
SGD				EUR			
EUR				SGD			

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
Total Anleihen		528.770,00	0,27
Nicht börsennotierte Wertpapiere		528.770,00	0,27
Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD BLACKROCK GLOBAL RL ASSET SEC FD D3 USD	45.000	3.004.200,00	1,53
USD SOURCE MORNINGSTAR US ENERGY ETF B USD	77.000	3.885.420,00	1,98
NOK STORM BOND FUND IC DIST NOK	300.000	3.142.102,82	1,60
USD THOMASLLOYD ENERGY IMPACT TRUS	1.600.000	288.000,00	0,15
Total Fondsanteile (Open-End)		10.319.722,82	5,27
Fondsanteile (Closed-End)			
USD ABERDEEN ASIA-PACIFIC INCOME FUND	125.000	331.250,00	0,17
GBP BLUEFIELD SOLAR INCOME FUND LT	295.000	398.131,85	0,20
USD EATON VANCE LIMITED DURATION INCOME FUND	35.000	343.350,00	0,18
GBP FORESIGHT SOLAR FUND LTD	350.000	390.810,91	0,20
GBP GCP INFRASTRUCTURE INVESTMENTS	400.000	401.824,15	0,21
GBP GREENCOAT UK WIND PLC/FUNDS	215.000	385.698,98	0,20
GBP JLEN ENVIRONMENTAL ASSETS GROU	346.850	387.735,22	0,20
GBP NEXTENERGY SOLAR FUND LTD	400.000	366.683,63	0,19
USD NUVEEN CREDIT STRATEGIES INCOME FUND	60.000	334.200,00	0,17
USD PGM GLOBAL HIGH YIELD FUND	25.000	295.250,00	0,15
USD VIRTUS ALLIANZGI CONVERTIBLE &	100.000	323.000,00	0,16
Total Fondsanteile (Closed-End)		3.957.934,74	2,02
Total Investmentfonds		14.277.657,56	7,29
Total des Wertpapierbestandes		192.211.602,94	98,13
Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.069.875,26	1,06
Andere Nettovermögenswerte		1.590.631,91	0,81
Teilfondsvermögen		195.872.110,11	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	32194771	LU1394300187	1,40%	1,68%
DB - Thesaurierend	USD	32199310	LU1394301078	0,00%	0,16%
FB - Thesaurierend	USD	19962726	LU0853133634	0,65%	0,89%
IB - Thesaurierend	USD	32197883	LU1394300856	1,00%	1,28%
UB - Thesaurierend	USD	32199377	LU1394301409	1,20%	1,48%
BH - Thesaurierend	CHF	32194253	LU1394299660	1,40%	1,69%
DBH - Thesaurierend	CHF	37394116	LU1644406644	0,00%	0,16%
FBH - Thesaurierend	CHF	19962934	LU0853132586	0,65%	0,89%
IBH - Thesaurierend	CHF	32197809	LU1394300344	1,00%	1,28%
UBH - Thesaurierend	CHF	32199312	LU1394301235	1,20%	1,48%
BH - Thesaurierend	EUR	32194256	LU1394299827	1,40%	1,68%
FBH - Thesaurierend	EUR	19962940	LU0853132669	0,65%	0,89%
IBH - Thesaurierend	EUR	32197816	LU1394300690	1,00%	1,27%
UBH - Thesaurierend	EUR	33809577	LU1485741976	1,20%	1,48%
FBH - Thesaurierend	GBP	19962948	LU0853132743	0,65%	0,89%
UBH - Thesaurierend	GBP	33929828	LU1491425333	1,20%	1,48%

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

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	USD	3,49%	/	3,30%	-5,21%	7,71%
DB - Thesaurierend	USD	4,17%	/	4,85%	-3,81%	9,34%
FB - Thesaurierend	USD	3,84%	/	4,11%	-4,47%	8,57%
IB - Thesaurierend	USD	3,67%	/	3,71%	-4,84%	8,14%
UB - Thesaurierend	USD	3,58%	/	3,50%	-5,03%	7,93%
BH - Thesaurierend	CHF	1,91%	/	-0,90%	-7,60%	6,61%
DBH - Thesaurierend	CHF	2,58%	/	0,59%	-6,23%	8,19%
FBH - Thesaurierend	CHF	2,24%	/	-0,12%	-6,86%	7,42%
IBH - Thesaurierend	CHF	2,07%	/	-0,50%	-7,23%	7,02%
UBH - Thesaurierend	CHF	1,99%	/	-0,70%	-7,41%	6,80%
BH - Thesaurierend	EUR	2,82%	/	1,12%	-7,29%	9,93%
FBH - Thesaurierend	EUR	3,17%	/	1,91%	-6,58%	7,64%
IBH - Thesaurierend	EUR	2,99%	/	1,52%	-6,94%	7,22%
UBH - Thesaurierend	EUR	2,91%	/	1,31%	-7,12%	7,00%
FBH - Thesaurierend	GBP	3,76%	/	3,40%	-5,18%	8,19%
UBH - Thesaurierend	GBP	3,51%	/	2,80%	-5,74%	7,51%

Erläuterungen

Finanzterminkontrakte

Beschreibung	Währung	Anzahl	Verpflichtungen (in Währung des Terminkontrakts)	Bewertung In USD
<i>Gegenpartei</i>				
CAD / USD FX CURRENCY -100000- 18/06/24	USD	-129	-9.467.310,00	18.329,50
EUR / USD FX CURRENCY -125000- 17/06/24	USD	-52	-7.052.500,00	-32.907,25
EURO BUND COMMODITIES -100000- 06/06/24	EUR	-55	-7.113.700,00	134.432,75
EURO STOXX 50 INDEX -10- 21/06/24	EUR	76	3.787.840,00	46.816,50
FTSE 100 INDEX -10- 21/06/24	GBP	53	4.391.580,00	336.876,90
GBP / USD FX CURRENCY -62500- 17/06/24	USD	107	8.514.525,00	12.966,38
HANG SENG Index -50- 27/06/24	HKD	20	18.009.000,00	-64.236,50
JAPANESE GOVERNMENT BOND FUTURES 10 YEAR	JPY	-20	-2.859.800.000,00	170.988,59
JPY / USD FX CURRENCY -125000- 17/06/24	USD	-42	-3.346.087,50	217.437,63
LONG GILT STERLING COMMODITIES -100000-	GBP	-45	-4.334.400,00	-14.089,64
NIKKEI 225 INDEX -1000- 13/06/24	JPY	13	500.370.000,00	-81.262,54
S&P E-MINI 500 INDEX -50- 21/06/24	USD	16	4.236.400,00	99.547,56
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 19/	USD	-57	-6.201.421,88	12.023,46
USD / AUD FX CURRENCY -100000- 17/06/24	USD	52	3.456.180,00	-1.126,00

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten

855.797,34

Gegenpartei: Credit Suisse AG, Goldman Sachs & Co. NY

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	166.297	EUR	-153.143	18.06.2024	-84,70
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	312.717	CHF	-281.957	18.06.2024	-458,34
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	256.987	CHF	-231.714	18.06.2024	-382,10
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	21.348	EUR	-19.678	18.06.2024	-31,43
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
GBP	39.587	USD	-50.322	18.06.2024	85,33
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	900.595	CHF	-820.880	18.06.2024	-11.152,54
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	248.328	EUR	-229.511	18.06.2024	-1.022,91
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	71.410	GBP	-55.890	18.06.2024	243,53
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	130.880	EUR	-120.260	18.06.2024	223,96
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	647.273	CHF	-588.359	18.06.2024	-6.218,75
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	3.853.946	EUR	-3.547.971	18.06.2024	-742,71
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	211.887	CHF	-193.219	18.06.2024	-2.720,32
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	18.457.420	CHF	-16.593.970	18.06.2024	26.063,41
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	2.366	EUR	-2.172	18.06.2024	6,51
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	4.142.980	CHF	-3.742.589	18.06.2024	-13.971,26
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	192.956	CHF	-174.520	18.06.2024	-885,46
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	246.111	EUR	-227.834	18.06.2024	-1.417,47
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	402.305	CHF	-363.421	18.06.2024	-1.351,96
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	15.961	GBP	-12.771	18.06.2024	-300,25
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	4.454.748	EUR	-4.146.942	18.06.2024	-50.653,01
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	360.886	CHF	-328.073	18.06.2024	-3.504,75
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	62.145	EUR	-58.021	18.06.2024	-891,51
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	112.881	EUR	-104.976	18.06.2024	-1.169,01
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	188.655	CHF	-171.159	18.06.2024	-1.452,57
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	18.931	GBP	-15.220	18.06.2024	-449,40
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	519.492	EUR	-485.007	18.06.2024	-7.437,05
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	286.022	CHF	-259.908	18.06.2024	-2.658,12
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	121.617	CHF	-110.110	18.06.2024	-682,94
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	2.890.907	EUR	-2.710.296	18.06.2024	-53.649,01
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	350.823	USD	-387.951	18.06.2024	1.716,35
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	709.894	EUR	-660.670	18.06.2024	-7.883,95
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	78.226	GBP	-62.328	18.06.2024	-1.137,47
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	102.762	EUR	-95.436	18.06.2024	-923,64
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	164.937	CHF	-149.448	18.06.2024	-1.056,56
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	27.751	GBP	-21.896	18.06.2024	-129,31
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	114.925	CHF	-103.028	18.06.2024	488,71
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	731.739	CHF	-658.410	18.06.2024	427,45
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
EUR	547.684	USD	-591.553	18.06.2024	3.477,62
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	104.966	CHF	-93.763	18.06.2024	820,12
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
CHF	2.326.933	USD	-2.614.047	18.06.2024	-29.468,83
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
GBP	11.987	USD	-15.111	18.06.2024	152,38
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	63.351	CHF	-56.417	18.06.2024	685,77
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	566.020	EUR	-521.626	18.06.2024	-699,58
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	1.487.191	CHF	-1.306.242	18.06.2024	36.244,53
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	71.342	EUR	-65.383	18.06.2024	306,19
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	73.304	GBP	-57.588	18.06.2024	-24,32
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	1.917	GBP	-1.505	18.06.2024	0,99
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	223.526	CHF	-194.056	18.06.2024	7.967,93
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	77.504	EUR	-70.700	18.06.2024	691,81
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	272.573	CHF	-236.284	18.06.2024	10.106,17
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	80.925	EUR	-73.643	18.06.2024	914,89
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	333.898	CHF	-291.800	18.06.2024	9.769,57
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	32.444	EUR	-29.756	18.06.2024	115,77
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
GBP	78.540	USD	-99.750	18.06.2024	256,77
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	36.357	EUR	-33.346	18.06.2024	128,42
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	43.405	CHF	-37.962	18.06.2024	1.237,39
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	297.502	EUR	-275.740	18.06.2024	-2.073,70
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	328.681	CHF	-295.909	18.06.2024	8,48
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	76.980	EUR	-71.666	18.06.2024	-881,16
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	145.184	CHF	-131.588	18.06.2024	-972,26
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	77.931	EUR	-72.824	18.06.2024	-1.187,61
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	240.037	CHF	-219.168	18.06.2024	-3.391,55
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	17.438	GBP	-13.939	18.06.2024	-310,34
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	310.220	CHF	-280.896	18.06.2024	-1.774,50
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	352.654	CHF	-319.715	18.06.2024	-2.455,38
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	751.396	CHF	-679.959	18.06.2024	-3.842,09
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	316.083	EUR	-296.048	18.06.2024	-5.553,99
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	137.018	CHF	-124.219	18.06.2024	-953,33
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	45.246	EUR	-42.470	18.06.2024	-894,96
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	122.514	EUR	-114.895	18.06.2024	-2.311,30
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	175.923	CHF	-159.616	18.06.2024	-1.363,70
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	173.313	GBP	-139.030	18.06.2024	-3.717,19
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	51.139	GBP	-40.353	18.06.2024	-243,32
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	43.384	CHF	-38.937	18.06.2024	135,50
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	23.970	GBP	-18.946	18.06.2024	-154,29
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
EUR	4.407	USD	-4.787	18.06.2024	0,67
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	1.456.810	CHF	-1.303.359	18.06.2024	9.120,69
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	22.210	EUR	-20.448	18.06.2024	-5,41
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	2.314.893	CHF	-2.061.675	18.06.2024	24.893,07
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	18.527.261	EUR	-17.041.976	18.06.2024	12.013,72
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	77.900	EUR	-71.484	18.06.2024	236,37
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	61.550	GBP	-48.403	18.06.2024	-82,82
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	243.489	EUR	-223.481	18.06.2024	687,38
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	360.024	CHF	-316.855	18.06.2024	8.069,28
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	78.668	EUR	-71.981	18.06.2024	464,13
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	107.912	EUR	-98.257	18.06.2024	1.159,57
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	466.340	EUR	-425.124	18.06.2024	4.461,46
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	46.696	GBP	-36.305	18.06.2024	467,52
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	56.852	EUR	-51.938	18.06.2024	423,48
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	75.558	CHF	-65.951	18.06.2024	2.299,70
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	75.552.471	USD	-82.379.581	18.06.2024	-295.674,59
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	1.964.663	USD	-2.142.195	18.06.2024	-7.688,71
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
EUR	1.629.232	USD	-1.776.366	18.06.2024	-6.288,02
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	20.919	GBP	-16.447	18.06.2024	-22,93
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	5.097.349	CHF	-4.651.040	18.06.2024	-68.529,96
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	4.947.698	EUR	-4.566.609	18.06.2024	-13.679,55
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	7.433.061	CHF	-6.774.393	18.06.2024	-91.229,30
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
EUR	890.531	USD	-965.952	18.06.2024	1.564,39
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	5.289.139	EUR	-4.876.033	18.06.2024	-8.415,31
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	75.853	GBP	-59.664	18.06.2024	-118,80
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	364.680	CHF	-331.257	18.06.2024	-3.248,48
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	660.660	EUR	-608.042	18.06.2024	53,47
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	63.702	GBP	-50.124	18.06.2024	-122,47
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	1.603.772	EUR	-1.473.513	18.06.2024	2.873,45
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	66.658	CHF	-60.332	18.06.2024	-353,51
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
CHF	1.796.641	USD	-1.992.447	18.06.2024	3.123,11
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	3.300	EUR	-3.031	18.06.2024	6,84
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	607.868	CHF	-548.142	18.06.2024	-963,63
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	316.981	EUR	-294.595	18.06.2024	-3.078,87
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	153.833	CHF	-139.087	18.06.2024	-652,68
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	68.636	GBP	-54.713	18.06.2024	-1.031,35
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	263.037	CHF	-237.506	18.06.2024	-764,59
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	7.647	GBP	-6.083	18.06.2024	-98,99
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	23.653	EUR	-21.915	18.06.2024	-156,16
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	163.574	CHF	-147.530	18.06.2024	-290,72
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	32.654	GBP	-26.016	18.06.2024	-472,84
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	1.127.475	CHF	-1.021.782	18.06.2024	-7.426,67
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	24.903	EUR	-23.220	18.06.2024	-323,67
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	2.361.814	CHF	-2.139.092	18.06.2024	-14.095,90
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	5.966	EUR	-5.587	18.06.2024	-104,21
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	324.037	CHF	-293.478	18.06.2024	-1.931,74
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	315.462	CHF	-285.210	18.06.2024	-1.324,48
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	478	GBP	-384	18.06.2024	-11,17
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	87.182	EUR	-81.720	18.06.2024	-1.601,09
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
EUR	2.235	USD	-2.432	18.06.2024	-4,29
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	247.088	USD	-275.520	18.06.2024	-1.074,09
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	68.760	EUR	-63.147	18.06.2024	153,40
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	62.576	CHF	-56.175	18.06.2024	181,17
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	167.378	EUR	-154.029	18.06.2024	33,56
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	934.871	GBP	-739.828	18.06.2024	-7.168,42
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	46.667	CHF	-41.726	18.06.2024	320,63
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	21.011	EUR	-19.291	18.06.2024	52,63
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	117.555	EUR	-108.532	18.06.2024	-359,40
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	24.646	GBP	-19.510	18.06.2024	-196,21
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	39.833	CHF	-35.778	18.06.2024	93,31
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	503.112	EUR	-463.487	18.06.2024	-442,24
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	10.801	CHF	-9.620	18.06.2024	116,10
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	107.033	EUR	-98.228	18.06.2024	312,69
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
GBP	65.692	USD	-83.569	18.06.2024	77,87
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	57.846	CHF	-51.054	18.06.2024	1.136,97
<i>Morgan Stanley Capital Services LLC - New-York - USA</i>					
USD	1.106.336	EUR	-1.012.872	18.06.2024	5.897,60
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	648.407	USD	-740.592	18.06.2024	-20.391,31
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	160.231	GBP	-125.584	18.06.2024	321,84
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	87.384	USD	-99.939	18.06.2024	-2.879,63
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					

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

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In USD)
USD	1.054.326	CHF	-916.820	18.06.2024	35.920,88
<i>Goldman Sachs International - London - United Kingdom</i>					
USD	45.267	CHF	-39.345	18.06.2024	1.562,89
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	386.436	EUR	-351.988	18.06.2024	4.015,54
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	116.384	CHF	-101.185	18.06.2024	3.987,93
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	3.979.177	USD	-4.548.141	18.06.2024	-128.377,35
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
CHF	121.665.746	USD	-139.062.158	18.06.2024	-3.925.215,32
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
GBP	3.560.906	USD	-4.522.542	18.06.2024	11.641,67
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	130.823	CHF	-114.452	18.06.2024	3.691,20
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	746.756	EUR	-686.496	18.06.2024	912,20
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	731.277	SEK	-7.811.993	20.06.2024	-12.215,84
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
CAD	4.440.535	USD	-3.260.791	20.06.2024	-2.057,95
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	13.029.685	EUR	-11.980.717	21.06.2024	11.379,54
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
NOK	56.370.924	USD	-5.261.862	21.06.2024	108.776,41
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
NZD	31.642.254	USD	-19.329.108	21.06.2024	110.820,38
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
GBP	10.293.701	USD	-13.033.185	21.06.2024	74.226,85
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	17.171.802	CHF	-15.480.677	21.06.2024	-28.725,57
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	22.714.522	EUR	-20.885.866	21.06.2024	19.837,84
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
USD	4.661.620	JPY	-720.918.429	21.06.2024	59.421,64
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
USD	9.351.607	AUD	-14.006.081	21.06.2024	31.524,48
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - United States of America</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-4.234.977,07

Swapkontrakte

Art		Verbindlichkeiten		Forderungen	Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>		Nennwert		Nennwert		(in USD)
ERS	USD	457.713	Neg. Perf. MQCPCINE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCINE - 24 Bps	22.07.2024	35.536,02
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>						
ERS	USD	470.973	Neg. Perf. MQCPCINE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCINE - 24 Bps	22.07.2024	33.188,23
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>						
ERS	USD	931.337	Neg. Perf. MQCPCINE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCINE - 24 Bps	22.07.2024	63.571,70
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>						
ERS	USD	914.865	Neg. Perf. MQCPCINE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCINE - 24 Bps	22.07.2024	69.141,87
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>						

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

Art	Verbindlichkeiten		Forderungen	Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>	Nennwert		Nennwert		(in USD)
ERS USD	804.592	Neg. Perf. MQCPCINE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCINE - 24 Bps	22.07.2024	47.857,94
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>					
ERS USD	197.166	Neg. Perf. MQCPCINE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCINE - 24 Bps	22.07.2024	1.958,58
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>					
ERS USD	4.014.083	Neg. Perf. MQCPCPRE + 17 Bps	Pos. Perf. MQCPCPRE - 17 Bps	22.07.2024	73.637,64
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>					
ERS USD	181.681	Neg. Perf. MQCPCINE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCINE - 24 Bps	22.07.2024	15.244,18
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>					
ERS USD	7.786	Neg. Perf. MQCPCENE + 24 Bps	Pos. Perf. MQCPCENE - 24 Bps	22.07.2024	-201,00
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>					
ERS USD	285.891	Neg. Perf. MQCPCAGE + 48 Bps	Pos. Perf. MQCPCAGE - 48 Bps	22.07.2024	-4.938,70
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>					
ERS USD	381.042	Neg. Perf. MQCPCAGE + 48 Bps	Pos. Perf. MQCPCAGE - 48 Bps	22.07.2024	-3.223,27
<i>Macquarie Bank Limited - Sydney - Australien</i>					
TRS USD	2.964.525	Neg. Perf. RTY + SOFRRATE + 17 Bps	Pos. Perf. RTY - (SOFRRATE + 17 Bps)	18.06.2024	-49.715,23
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
TRS USD	34.094.119	Neg. Perf. SPX + SOFRRATE + 20 Bps	Pos. Perf. SPX - (SOFRRATE + 20 Bps)	18.06.2024	-243.711,95
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
TRS	USD	3.830.985	Neg. Perf. IXU + SOFRRATE + 37 Bps	18.06.2024	-15.971,23
<i>Bank of America - Charlotte - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>					
TRS USD	600.000	Neg. Perf. IBOXHY + (SOFRRATE - 0 Bps)	Pos. Perf. IBOXHY - (SOFRRATE - 0 Bps)	20.06.2024	8.849,86
<i>JP Morgan Chase Bank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>					
TRS USD	5.700.000	Neg. Perf. IBOXHY + (SOFRRATE - 0 Bps)	Pos. Perf. IBOXHY - (SOFRRATE - 0 Bps)	20.06.2024	-8.032,13
<i>BNP Paribas S.A. - Paris - Frankreich</i>					
TRS	USD	4.114.837	Neg. Perf. GDDUEAFE + SOFRRATE + 63 Bps	20.06.2024	45.144,99
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>					
TRS	GBP	108.239	Neg. Perf. BDEV LN Equity + SONIO/N - 42 Bps	18.03.2025	-2.492,61
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>					
TRS GBP	152.643	Neg. Perf. VMUK LN Equity + SONIO/N + 48 Bps	Pos. Perf. VMUK LN Equity - (SONIO/N + 48 Bps)	28.03.2025	-3.042,72
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>					
TRS GBP	43.623	Neg. Perf. SPT LN Equity + SONIO/N + 48 Bps	Pos. Perf. SPT LN Equity - (SONIO/N + 48 Bps)	10.04.2025	-3.013,55
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>					
TRS GBP	17.483	Neg. Perf. SPT LN Equity + SONIO/N + 48 Bps	Pos. Perf. SPT LN Equity - (SONIO/N + 48 Bps)	11.04.2025	-1.207,78
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>					
TRS GBP	24.007	Neg. Perf. SPT LN Equity + SONIO/N + 48 Bps	Pos. Perf. SPT LN Equity - (SONIO/N + 48 Bps)	14.04.2025	-1.658,42
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>					
TRS GBP	16.940	Neg. Perf. SPT LN Equity + SONIO/N + 48 Bps	Pos. Perf. SPT LN Equity - (SONIO/N + 48 Bps)	15.04.2025	-1.170,23
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>					
TRS	USD	229.753	Neg. Perf. APA US Equity + SOFRRATE - 10 Bps	21.04.2025	-1.638,75
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>					

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

Art	Verbindlichkeiten		Forderungen		Fälligkeit	Bewertung	
<i>Gegenpartei</i>	Nennwert		Nennwert			(in USD)	
TRS		USD	185.413	Neg. Perf. CHRD US Equity + SOFRRATE - 10 Bps	21.04.2025	-8.587,68	
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS		USD	193.093	Neg. Perf. EQT US Equity + SOFRRATE - 10 Bps	21.04.2025	-11.173,36	
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS		USD	411.565	Neg. Perf. CVX US Equity + SOFRRATE - 10 Bps	21.04.2025	4.562,21	
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS		USD	188.168	Neg. Perf. SNPS US Equity + SOFRRATE - 10 Bps	21.04.2025	-809,33	
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS		USD	73.575	Neg. Perf. PFS US Equity + SOFRRATE - 10 Bps	21.04.2025	-1.113,36	
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	GBP	134.071		Neg. Perf. DARK LN Equity + SONIO/N + 48 Bps	Pos. Perf. DARK LN Equity - (SONIO/N + 48 Bps)	06.05.2025	-3.016,28
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>							
TRS		USD	207.144	Neg. Perf. SLB US Equity + SOFRRATE - 10 Bps		09.05.2025	11.778,19
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	236.748		Neg. Perf. EDR US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. EDR US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	09.05.2025	2.436,45
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	265.762		Neg. Perf. SWAV US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. SWAV US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	12.05.2025	2.698,41
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	182.424		Neg. Perf. AIRC US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. AIRC US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	15.05.2025	105,27
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	111.496		Neg. Perf. MODN US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. MODN US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	15.05.2025	42,90
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS		EUR	188.030	Neg. Perf. BBVA SM Equity + ESTRON - 40 Bps		16.05.2025	2.241,81
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>							
TRS	SEK	897.915		Neg. Perf. OX2 SS Equity + STIBOR 1MO + 45 Bps	Pos. Perf. OX2 SS Equity - (STIBOR 1MO + 45 Bps)	20.05.2025	440,17
<i>Goldman Sachs International - London - Vereinigtes Königreich</i>							
TRS	USD	177.248		Neg. Perf. WIRE US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. WIRE US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	22.05.2025	4.354,23
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	104.157		Neg. Perf. HIBB US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. HIBB US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	30.05.2025	-692,36
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	195.357		Neg. Perf. HCP US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. HCP US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	02.06.2025	3.999,25
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	103.317		Neg. Perf. SLCA US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. SLCA US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	03.06.2025	-541,58
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	109.124		Neg. Perf. DCPH US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. DCPH US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	06.06.2025	413,45
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS		USD	123.720	Neg. Perf. UMBF US Equity + SOFRRATE - 10 Bps		06.06.2025	436,80
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							
TRS	USD	153.865		Neg. Perf. ALE US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. ALE US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	13.06.2025	419,14
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>							

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

Art		Verbindlichkeiten		Forderungen	Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>		Nennwert		Nennwert		(in USD)
TRS	USD	117.331	Neg. Perf. PRFT US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. PRFT US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	13.06.2025	605,17
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>						
TRS	USD	145.333	Neg. Perf. SQSP US Equity + SOFRRATE + 35 Bps	Pos. Perf. SQSP US Equity - (SOFRRATE + 35 Bps)	20.06.2025	-604,68
<i>Citibank N.A. - New-York - Vereinigten Staaten Von Amerika</i>						
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten						62.108,26

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.05.2024			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		144.310.294,31			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		44.462.811,10			
Forderungen aus Zeichnungen		19.809,20			
Forderungen aus Erträgen		745,61			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten		855.797,34			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten		62.108,26			
Andere Aktiva		667,57			
		189.712.233,39			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		684.991,89			
Rückstellungen für Aufwendungen		318.220,00			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		160.217,60			
		4.234.977,07			
		5.398.406,56			
Nettovermögen		184.313.826,83			
Teilfondsentwicklung		31.05.2024	30.11.2023	30.11.2022	
Teilfondsvermögen	USD	184.313.826,83	481.791.118,64	832.130.436,45	
Nettoinventarwert pro Aktie					
B - Thesaurierend	USD	144,58	138,19	136,04	
DB - Thesaurierend	USD	1.850,23	1.754,89	1.701,79	
FB - Thesaurierend	USD	1.574,54	1.499,03	1.464,13	
IB - Thesaurierend	USD	1.501,72	1.432,49	1.404,58	
UB - Thesaurierend	USD	131,05	125,13	122,94	
BH - Thesaurierend	CHF	113,34	110,44	113,37	
DBH - Thesaurierend	CHF	1.170,81	1.132,07	1.144,80	
FBH - Thesaurierend	CHF	1.244,62	1.208,02	1.230,41	
IBH - Thesaurierend	CHF	1.186,74	1.154,10	1.180,01	
UBH - Thesaurierend	CHF	103,64	100,89	103,37	
BH - Thesaurierend	EUR	121,02	116,62	117,37	
FBH - Thesaurierend	EUR	1.327,89	1.274,52	1.272,69	
IBH - Thesaurierend	EUR	1.259,92	1.211,71	1.214,71	
UBH - Thesaurierend	EUR	113,71	109,46	109,95	
FBH - Thesaurierend	GBP	1.253,87	1.195,23	1.176,10	
UBH - Thesaurierend	GBP	122,24	116,86	115,67	
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B - Thesaurierend	USD	12.702,444	14.151,841	433,181	1.882,578
DB - Thesaurierend	USD	7.595,627	14.586,449	3.040,268	10.031,090
FB - Thesaurierend	USD	22.675,984	47.186,551	6.775,681	31.286,248
IB - Thesaurierend	USD	671,288	671,288	0,000	0,000
UB - Thesaurierend	USD	25.820,424	15.345,424	11.917,000	1.442,000
BH - Thesaurierend	CHF	9.656,548	10.657,580	143,528	1.144,560
DBH - Thesaurierend	CHF	10.280,000	21.660,000	10.341,752	21.721,752
FBH - Thesaurierend	CHF	36.586,656	137.768,399	6.993,075	108.174,818
IBH - Thesaurierend	CHF	17.817,356	17.676,578	248,595	107,817
UBH - Thesaurierend	CHF	7.637,377	8.157,437	336,173	856,233
BH - Thesaurierend	EUR	12.289,250	13.742,441	1.980,531	3.433,722
FBH - Thesaurierend	EUR	21.413,347	82.337,299	2.108,685	63.032,637

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung (Fortsetzung)

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
IBH - Thesaurierend	EUR	2.522,355	10.157,369	45,000	7.680,014
UBH - Thesaurierend	EUR	2.753,747	3.603,747	0,000	850,000
FBH - Thesaurierend	GBP	1.687,557	3.398,064	142,942	1.853,449
UBH - Thesaurierend	GBP	83,605	83,605	0,000	0,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	481.791.118,64
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	45.682,24
Dividenden (Netto)	50.028,83
Bankzinsen	1.717.628,95
	1.813.340,02
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.094.638,93
Depotbank- und Depotgebühr	103.195,01
Zentralverwaltungsvergütung	135.951,31
Druck- und Veröffentlichungskosten	8.333,93
Zinsen und Bankspesen	64.630,93
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	131.219,83
"Taxe d'abonnement"	18.783,19
	1.556.753,13
Nettoerträge (-verluste)	256.586,89
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	13.273.887,54
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	422.200,55
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	8.382.936,33
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-3.938.222,74
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-550.638,62
	17.590.163,06
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	17.846.749,95
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-4.107.289,24
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	94.037,12
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-840.796,15
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-5.510.896,94
	-10.364.945,21
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	7.481.804,74
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	44.816.635,97
Rücknahmen	-349.775.732,52
	-304.959.096,55
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	184.313.826,83

Aufstellung des Wertpapierbestandes**Geographische Aufteilung**

Vereinigte Staaten	77,92
Grossbritannien	0,15
Britische Jungferinseln	0,13
Spanien	0,10
Total	78,30

Wirtschaftliche Aufteilung

Länder und Zentralregierungen	76,45
Petroleum	0,42
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	0,24
Biotechnologie	0,24
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,23
Banken und andere Kreditinstitute	0,17
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	0,16
Computerhardware und Netzwerk	0,13
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,11
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,10
Elektronik und Halbleiter	0,08
Baustoffe und Bauindustrie	0,08
Einzelhandel und Warenhäuser	0,06
Index	-0,16
Total	78,30

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
USD AMEDISYS	1.553	141.555,95	0,08
USD ANSYS	981	311.418,45	0,17
USD AXONICS MODULATION TECHNOLOGIE	2.356	158.064,04	0,09
EUR BANCO DE SABADELL (REG. SHARES)	90.463	190.373,56	0,10
USD CAPRI HOLDINGS LTD	3.017	104.237,35	0,06
USD CATALENT	3.638	195.688,02	0,11
USD CERVEL THERAPEUTICS HOLDINGS	6.099	248.473,26	0,13
USD CHAMPIONX CORP	5.810	189.522,20	0,10
USD EQUITRANS MIDSTREAM CORP	14.155	202.133,40	0,11
USD EVERBRIDGE INC	3.679	127.682,04	0,07
USD HEARTLAND FINANCIAL USA	2.727	119.878,92	0,07
USD HESS	2.422	373.230,20	0,20
USD HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES	6.154	130.280,18	0,07
USD JUNIPER NETWORKS	6.925	247.014,75	0,13
USD NATIONAL WESTERN LIFE GROUP A	323	158.431,50	0,09
GBP NETWORK INTERNATIONAL HOLDINGS	26.271	131.452,30	0,07
USD OASIS PETROLEUM INC	1.032	191.343,12	0,10
GBP REDROW PLC	15.253	138.272,02	0,08
USD UNITED STATES STEEL	5.283	202.986,55	0,11
USD VIZIO HOLDING CORP A	13.881	149.081,94	0,08
Total Aktien		3.711.319,75	2,01
Verkaufsoptionen (put)			
USD S&P 500 (PUT) -5295- 21/06/24	-58	-303.920,00	-0,16
Total Verkaufsoptionen (put)		-303.920,00	-0,16
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
		3.407.399,75	1,85
Geldmarktinstrumente			
USD TREASURY BILL 0%/23-050924	18.000.000	17.750.427,25	9,63
USD TREASURY BILL 0%/23-080824	9.000.000	8.911.067,63	4,83
USD TREASURY BILL 0%/23-130624	18.000.000	17.966.876,01	9,75
USD TREASURY BILL 0%/23-261224	9.000.000	8.758.866,23	4,75
USD TREASURY BILL 0%/23-291124	18.000.000	17.578.654,59	9,54
USD TREASURY BILL 0%/23-311024	9.000.000	8.819.746,96	4,79
USD WI TREASURY BILL 0%/23-031024	9.000.000	8.839.359,40	4,80
USD WI TREASURY BILL 0%/23-110724	9.000.000	8.948.340,00	4,85
USD WI TREASURY BILL 0%/24-170425	9.000.000	8.607.724,62	4,67
USD WI TREASURY BILL 0%/24-200225	18.000.000	17.360.952,42	9,42
USD WI TREASURY BILL 0%/24-200325	9.000.000	8.639.947,00	4,69
USD WI TREASURY BILL 0%/24-230125	9.000.000	8.720.932,45	4,73
Total Geldmarktinstrumente		140.902.894,56	76,45
Total des Wertpapierbestandes		144.310.294,31	78,30
Bareinlagen bei Banken und Brokern		44.462.811,10	24,12
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-684.991,89	-0,37
Andere Passiva		-3.774.286,69	-2,05
Teilfondsvermögen		184.313.826,83	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
EB - Thesaurierend	USD	20113854	LU0861833076	0,50%

Mit Wirkung zum 07.12.2023 wurde der Liquidationsprozess des Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund eingeleitet.

Fondsperformance

			YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
EB - Thesaurierend	USD		4,72%	/	7,29%	-22,73%	-3,85%

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

Teilfondsentwicklung		31.05.2024	30.11.2023	30.11.2022	
Teilfondsvermögen	USD	2.996.381,00*	285.378.284,62	228.405.124,87	
Nettoinventarwert pro Aktie					
EB - Thesaurierend	USD	1,33	120,16	112,21	
* TNA vor Liquidation.					
Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
EB - Thesaurierend	USD	0,000	2.368.967,948	241,474	2.369.209,422

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
31.05.2024

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	285.378.284,62
Erträge	
Bankzinsen	215.318,71
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	63,16
Andere Erträge	108.050,61
	323.432,48
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	31.150,15
Depotbank- und Depotgebühr	3.893,76
Zentralverwaltungsvergütung	6.284,09
Druck- und Veröffentlichungskosten	1.426,29
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	33.222,76
	75.977,05
Nettoerträge (-verluste)	247.455,43
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-14.814.696,42
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	4.679,35
	-14.810.017,07
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-14.562.561,64
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	11.131.084,39
	11.131.084,39
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-3.431.477,25
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	94.974,01
Rücknahmen	-282.041.781,38
	-281.946.807,37
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	0,00

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr
EB - Thesaurierend	USD	20113857	LU0861833316	0,50%
EBH - Thesaurierend	CHF	20113914	LU0861833589	0,50%
EBH - Thesaurierend	EUR	20113929	LU0861833662	0,50%

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, den Teilfonds Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund zum 08.12.2023 zu liquidieren, der Liquidations-NIW wurde zum 11.12.2023 berechnet.

Fondsperformance

		PTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
EB - Thesaurierend	USD	9,31%	/	-9,92%	3,78%	3,78%
EBH - Thesaurierend	CHF	5,08%	/	-12,31%	2,70%	1,74%
EBH - Thesaurierend	EUR	7,04%	/	-11,93%	2,90%	9,15%

PTD = Performance To Date (01.01.2023 - 08.12.2023)

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

Teilfondsentwicklung		08.12.2023	30.11.2023	30.11.2022
Teilfondsvermögen	USD	95.726.875,00*	104.337.775,98	122.448.849,56
Nettoinventarwert pro Aktie				
EB - Thesaurierend	USD	132,25	131,75	121,08
EBH - Thesaurierend	CHF	104,86	104,61	100,26
EBH - Thesaurierend	EUR	110,35	109,98	103,45

* TNA vor Liquidation.

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Berichtsperiode	zu Beginn der Berichtsperiode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
EB - Thesaurierend	USD	0,000	94.347,846	0,000	94.347,846
EBH - Thesaurierend	CHF	0,000	395.662,721	0,000	395.662,721
EBH - Thesaurierend	EUR	0,000	368.783,922	0,000	368.783,922

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in USD)Für die Periode vom
01.12.2023 bis zum
08.12.2023
(Liquidationsdatum)

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	104.337.775,98
Erträge	
Bankzinsen	2.036,67
	2.036,67
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	15.281,23
Depotbank- und Depotgebühr	1.910,22
Zentralverwaltungsvergütung	3.063,18
Druck- und Veröffentlichungskosten	283,50
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	18.972,58
	39.510,71
Nettoerträge (-verluste)	-37.474,04
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	17.307.457,33
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	676.431,32
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-261.256,34
	17.722.632,31
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	17.685.158,27
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-16.918.550,82
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-1.655.650,76
	-18.574.201,58
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-889.043,31
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	31.016,38
Rücknahmen	-103.479.749,05
	-103.448.732,67
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	0,00

Vergütung

Informationen zur Vergütung werden gemäss Paragraf 111bis und 111ter des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils geltenden Fassung offengelegt, sobald ein vollständiges Geschäftsjahr abgeschlossen wurde.

Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("CSFT") und Total-Return-Swaps ("TRS")**Arten von SFT und TRS**

Zum 31.05.2024 war die Gesellschaft an Wertpapierleihgeschäften und Total-Return-Swaps beteiligt.

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Die Verwahrung von Sicherheiten erfolgt durch Credit Suisse (Luxembourg) S.A. (die "Depotbank"). Die Sicherheiten im Zusammenhang mit TRS-Geschäften werden auf getrennten Konten gehalten; die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften erhaltenen Sicherheiten werden auf 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 31.05.2024 partizipierten die Subfonds ausschließlich am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich (der „Principal“).

Der Umfang von verliehenen Wertpapieren als Teil der gesamten verleihbaren Vermögenswerte, die gemäss Definition keine Barmittel und Barmitteläquivalente umfassen, und als Teil des Nettogesamtvermögens sind der nachfolgenden Tabelle zu entnehmen. Der Umfang des Vermögens, das in jeder Art von SFT angelegt ist, die Gegenparteien, die Angaben zu den Sicherheiten und die Rendite- und Kostenangaben sind in den Erläuterungen dieses Berichts enthalten.

Subfonds	Währung	Umfang der verliehenen Wertpapiere als Anteil vom gesamten verleihbaren Vermögen (in %)*	Summe des Wertpapierleihgeschäftes im Vergleich zum Nettoinventarwert (%)
Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund	USD	36,10	33,93
Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	EUR	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	EUR	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	5,70	5,60
Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation)	USD	0,00	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023)	USD	0,00	0,00

* ohne Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Daten zu Emittenten von Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte

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

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

Sicherheitsemitter	Gesamtumfang der Sicherungswertpapiere und -rohstoffe, die pro Emittent auf Pool-Ebene erhalten wurden (in CHF)
US TREASURY	102.370.945,84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	87.293.571,72
FRANCE (GOVT OF)	79.369.873,15
REPUBLIC OF AUSTRIA	50.191.435,30
BELGIUM KINGDOM	32.004.733,59
EUROPEAN UNION	25.743.178,94
EURO STABILITY MECHANISM	22.595.572,16
NETHERLANDS GOVERNMENT	15.156.927,34
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12.868.586,10
PFANDBRIEF SCHWEIZ HYPO	12.446.155,82

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

Subfonds

Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund	6,83%
Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)	/
Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund	/
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	/
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	/
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	2,02%
Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta	/
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation)	/
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023)	/

Fälligkeit der Sicherheiten in Verbindung mit SFT

Subfonds	Währung	Fälligkeit der Sicherheit						Offene Fälligkeit
		Weniger als 1 Woche	Weniger als 1 Monat	Von 1 Monat bis 3 Monate	Von 3 Monaten bis 1 Jahr	Über 1 Jahr		
Credit Suisse (Lux) Alternative Opportunities Fund	USD	0,00	193.998,02	3.369.913,91	4.808.165,58	26.836.162,51	3.820.434,34	
Credit Suisse (Lux) Capital Allocation Fund (bis zum 06.02.2024)	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	EUR	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	EUR	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	0,00	57.368,97	996.548,78	1.421.867,65	7.935.972,81	1.129.776,40	
Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund (in Liquidation)	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund (bis zum 08.12.2023)	USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

Total Return Swaps ("TRS")

Einzelheiten zu den TRS (Name der Kontrahenten, Land der Kontrahenten, Volumen der Transaktionen), die am Bilanzstichtag von den einzelnen Subfonds gehalten wurden, sind im Abschnitt Technische Daten und Erläuterungen der einzelnen Subfonds im vorliegenden Bericht aufgeführt.

Die untenstehende Tabelle enthält die Beträge der von den einzelnen Subfonds in TRS eingesetzten Vermögenswerte, jeweils nach Forderungen und Verbindlichkeiten, eingeteilt nach Restlaufzeit. Die Restlaufzeit bezieht sich auf das Datum der Fälligkeit des Total Return Swaps am Bilanzstichtag.

Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta**Betrag des in TRS eingesetzten Vermögens (in USD)**

Restlaufzeit der TRS	Absoluter Betrag von Verbindlichkeiten/Forderungen aus TRS (in USD)	Als Anteil vom Nettovermögen (in %)
Zahlbar innerhalb von weniger als 1 Monat	43.358.643,99	23,52
Zu vereinnahmen innerhalb von weniger als 1 Monat	7.945.822,15	4,31
Zu zahlen innerhalb von 1 bis 3 Monaten	0,00	0,00
Zu vereinnahmen innerhalb von 1 bis 3 Monaten	0,00	0,00
Zu zahlen innerhalb von 3 bis 6 Monaten	0,00	0,00
Zu vereinnahmen innerhalb von 3 bis 6 Monaten	0,00	0,00
Zu zahlen innerhalb von 6 bis 9 Monaten	0,00	0,00
Zu vereinnahmen innerhalb von 6 bis 9 Monaten	0,00	0,00
Zu zahlen innerhalb von 9 bis 12 Monaten	1.658.191,84	0,90
Zu vereinnahmen innerhalb von 9 bis 12 Monaten	1.830.645,03	0,99
Zu zahlen in über 12 Monaten	824.326,99	0,45
Zu vereinnahmen in über 12 Monaten	123.720,00	0,07
Gesamt	55.741.350,00	30,24

Mit diesen Transaktionen sind keine Kosten verbunden, da sie im Spread jeder Transaktion enthalten sind.

Der Wert der TRS zum Datum der Fälligkeit wird bar gehalten, mit offener Laufzeit.

CREDIT SUISSE 

Teil des UBS-Konzerns

CREDIT SUISSE FUND MANAGEMENT S.A.

5, rue Jean Monnet

L-2180 Luxembourg

www.credit-suisse.com