

CS Investment Funds 14

Investment Fund under Luxembourg law –

R.C.S. K673

**Geprüfter Jahresbericht zum
31.03.2023**

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
Prüfungsvermerk	4
Kombinierter Bericht	10
Erläuterungen	12
Tätigkeitsbericht (ungeprüft)	15
Bericht per Subfonds	
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	17
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	22
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	27
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	32
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	38
Ungeprüfte Informationen	
Vergütung	43
Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT") und Total-Return-Swaps ("TRS")	43
Transparenz bei der Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen	46

Verwaltung und Organe

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Daniela Klasén-Martin
Managing Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Thomas Nummer (bis zum 30.04.2023)
Independent Director, Luxemburg

Daniel Siepmann (bis zum 10.05.2022)
Managing Director, Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxemburg

Markus Ruetimann (seit dem 12.05.2022)
Managing Director, Credit Suisse Asset Management Limited, Vereinigtes
Königreich

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

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

Depotbank und Zahlstelle

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

Zentrale Verwaltungsstelle

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

Abschlussprüfer

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

Anlageverwalter

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

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

Rechtsberater

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

Vertriebsstelle

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

Vertreter in der Schweiz

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

Zahlstelle in der Schweiz

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

Vertreter und Zahlstellen ausserhalb von Luxemburg und der Schweiz

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

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

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

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



To the Unitholders of
CS Investment Funds 14

Our opinion

In our opinion, the accompanying financial statements give a true and fair view of the financial position of CS Investment Funds 14 (the "Fund") and of each of its sub-funds as at 31 March 2023, and of the results of their operations and changes in their net assets for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements.

What we have audited

The Fund's financial statements comprise:

- the Combined Statement of Net Assets for the Fund and the Statement of Net Assets for each of the sub-funds as at 31 March 2023;
- the Statement of Investments in Securities for each of the sub-funds as at 31 March 2023;
- the Combined Statement of Operations / Changes in Net Assets for the Fund and the Statement of Operations / Changes in Net Assets for each of the sub-funds for the year then ended; and
- the notes to the financial statements, which include a summary of significant accounting policies.

Basis for opinion

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

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

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

Other information

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

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



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

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

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

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

Responsibilities of the "Réviseur d'entreprises agréé" for the audit of the financial statements

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

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

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



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

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Represented by

Luxembourg, 20 July, 2023

Sandra Paulis



An die Anteilinhaber des
CS Investment Funds 14

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der CS Investment Funds 14 („der Fonds“) und seiner jeweiligen Subfonds zum 31. März 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Was wir geprüft haben

Der Abschluss des Fonds besteht aus:

- der kombinierten Nettovermögensaufstellung für den Fonds und der Nettovermögensaufstellung für jeden der Subfonds zum 31. März 2023;
- der Aufstellung des Wertpapierbestandes zum 31. März 2023;
- der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens für den Fonds und der Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens für jeden der Subfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr; und
- einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden und anderen erläuternden Informationen (Anhang).

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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

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

Sonstige Informationen

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

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



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

Verantwortung des Verwaltungsrates der Verwaltungsgesellschaft für den Abschluss

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

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

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

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben, entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen ist, und darüber einen Prüfungsvermerk, der unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche unzutreffende Angabe, falls vorhanden, aufdeckt. Unzutreffende Angaben können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen könnten.

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

- identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen unzutreffenden Angaben im Abschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Angaben nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können;
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangangaben;



- schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Tätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Tätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Prüfungsvermerk auf die dazugehörigen Anhangsangaben zum Abschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Prüfungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Tätigkeit nicht mehr fortführen kann;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Anhangsangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, den 20 Juli 2023

Sandra Paulis

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

Nettovermögensaufstellung (in CHF)**31.03.2023****Aktiva**

Wertpapierbestand zum Marktwert	1.348.491.414,22
Bareinlagen bei Banken und Brokern	24.858.490,59
Forderungen aus Erträgen	8.287.999,74
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten	450.131,23
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	361.632,58
	1.382.449.668,36

Passiva

Bankverbindlichkeiten und sonstige	1.210.442,84
Rückstellungen für Aufwendungen	627.560,34
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	87.946,90
	1.925.950,08

Nettovermögen	1.380.523.718,28
----------------------	-------------------------

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens (in CHF)Für die Periode vom
01.04.2022 bis zum
31.03.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	1.665.633.375,69
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	24.488.213,85
Bankzinsen	127.551,63
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	240.610,25
	24.856.375,73
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	4.806.623,08
Depotbank- und Depotgebühr	859.979,56
Zentralverwaltungsvergütung	816.953,56
Druck- und Veröffentlichungskosten	103.992,65
Zinsen und Bankspesen	94.171,44
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	556.134,98
"Taxe d'abonnement"	341.792,81
	7.579.648,08
Nettoerträge (-verluste)	17.276.727,65
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-36.882.177,07
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	186.389,04
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	17.433.255,55
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-6.734.900,60
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-857.335,18
	-26.854.768,26
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-9.578.040,61
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-10.875.252,25
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-12.367.229,77
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	725.559,05
	-22.516.922,97
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-32.094.963,58
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	250.349.922,99
Rücknahmen	-483.957.041,99
	-233.607.119,00
Ausschüttung	-1.250.493,24
Währungsdifferenz	-18.157.081,59
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	1.380.523.718,28

Allgemeines

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

Zum 31.03.2023 hatte der Fonds fünf Subfonds aufgelegt.

Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

a) Darstellung des Abschlusses

Der Abschluss des Fonds wurde gemäss den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen für Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt.

b) Berechnung des Nettoinventarwerts des jeweiligen Subfonds

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

Der Abschluss berücksichtigt die am 31.03.2023 berechneten Nettoinventarwerte.

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

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

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

Zum 31.03.2023 wurde bei keinem der von diesem Jahresbericht abgedeckten Subfonds das Swing-Pricing angewendet.

c) Bewertung des Wertpapierbestands des jeweiligen Subfonds

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

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

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

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

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

d) Guthaben bei Banken und Maklern

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

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

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

f) Währungsumrechnung

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

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

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

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

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

g) Buchung von Wertpapiertransaktionen der einzelnen Subfonds

Die Wertpapiergeschäfte werden an den Transaktionstagen gebucht.

h) Bewertung von Finanzterminkontrakten der einzelnen Subfonds

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

i) Bewertung von Devisenterminkontrakten der einzelnen Subfonds

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

j) Bewertung von Swaps

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

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

k) Zuordnung der Aufwendungen

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

l) Wertpapierleihgeschäfte

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

m) Buchung von Erträgen

Dividenden werden zum Ex-Dividenddatum gebucht, nach Abzug der Quellensteuer.

Zinsen werden auf täglicher Basis gebucht.

Verwaltungsgebühr

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

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

"Taxe d'abonnement"

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

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

Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER)

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

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

Die TER wird nach der AMAS-Richtlinie berechnet.

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

Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

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

Depotbankgebühr

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

Wechselkurse

Der konsolidierte Abschluss wird in CHF erstellt. Zu diesem Zweck wird der Abschluss der einzelnen Subfonds zu dem am 31.03.2023 geltenden Wechselkursen in CHF umgerechnet:

1 EUR	= 0,992500	CHF
1 USD	= 0,913526	CHF

Fondsperformance

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die Performance des Jahres N basiert auf den am letzten Geschäftstag des Jahres N bzw. N-1 berechneten Nettoinventarwerten. Diese Nettoinventarwerte spiegeln die Marktpreise der Anlagen am letzten Geschäftstag des Jahres N bzw. N-1 wider. Die Performance seit Jahresbeginn (YTD) bezieht sich auf den Zeitraum vom 01.01.2023 bis zum 31.03.2023.

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

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

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

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

Risikomanagement

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

Transaktionskosten

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

In dem am 31.03.2023 abgeschlossenen Jahr entstanden dem Fonds folgende Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Kauf oder Verkauf von Wertpapieren und ähnlichen Geschäften (einschliesslich derivativer Finanzinstrumente oder anderer zulässiger Vermögenswerte):

Subfonds	Währung	Transaktionskosten
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	373,20
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	50,00
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	816,96
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	CHF	-
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	-

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

Wertpapierleihe

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

Subfonds	Währung	Marktwert der Wertpapierleihe	Marktwert der Sicherheiten
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	9.018.608,00	9.482.269,98
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	13.876.297,00	14.589.701,04
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	5.782.741,00	6.080.041,55
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	CHF	2.253.371,00	2.369.220,64
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	16.305.221,00	17.143.500,16

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

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

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

Für das Jahr bis zum 31.03.2023 belief sich die an den Principal gezahlte Gebühr auf folgende Beträge:

Subfonds	Währung	Bruttobetrag Wertpapierleihe	Aufwendungen und Provisionen von der Gegenpartei	Nettobetrag des Ertrags aus Wertpapierleihe
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	48.169,94	14.450,98	33.718,96
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	157.144,29	47.143,29	110.001,00
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	108.225,23	32.467,57	75.757,66
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	CHF	9.481,04	2.844,31	6.636,73
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	31.245,71	9.373,71	21.872,00

Derivative Finanzinstrumente

Der Subfonds kann Derivategeschäfte zum Zweck der effizienten Portfolioverwaltung tätigen.

Zum 31.03.2023 hatte der Fonds keine Sicherheiten angenommen, um das Gegenparteirisiko zu mindern.

Barsicherheiten

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

Subfonds	Gegenpartei	Währung	Betrag
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	JPMorgan Chicago	CHF	1.660.000,00

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

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

Bedeutende Ereignisse während des Jahres

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

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

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

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Der neue Verkaufsprospekt trat im Mai 2023 in Kraft.

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

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund

Nach fast zwei Jahren von Problemen im Zusammenhang mit COVID-19 stieg die Inflation, die bereits 2021 aufgrund der jahrelangen extrem lockeren Geldpolitik und der Lieferkettenprobleme erste Spuren hinterliess, nach der Invasion Russlands in die Ukraine und den damit verbundenen Verwerfungen der Versorgung mit Energie und landwirtschaftlichen Erzeugnissen weiter an. Letztendlich haben alle grossen Zentralbanken mit der schwindenden Hoffnung, dass die Inflation nur vorübergehend sein könnte, begonnen, sehr schnell Ihre Leitzinsen anzuheben – und das mit ungewöhnlich grossen Schritten, die es seit mindestens zehn Jahren nicht mehr gegeben hat. Ungewissheit im Hinblick auf den Verlauf der Inflation, das Ausmass der geldpolitischen Straffung und letztendlich einer Rezession, die selbst verursachte Wachstumsschwäche Chinas in Verbindung mit zunehmenden geopolitischen Risiken belasteten die Stimmung der Anleger massiv und führten über den Berichtszeitraum zu einer weitgehenden Umschichtung in weniger risikoreiche Anlagen.

Das erste Quartal 2023 endete weitgehend im positiven Bereich, wengleich am Markt phasenweise ein hohes Mass an Volatilität herrschte. Noch Anfang März waren die Konjunkturdaten gut, die Inflation hielt sich weiter hartnäckig, der Tonfall des Fed-Vorsitzenden in seiner Rede vor dem Kongress war restriktiv und somit stiegen die Erwartungen im Hinblick auf den endgültigen Zinssatz der weltweiten Zentralbanken in ihrem Kampf zur Eindämmung der Inflation. Gegen Mitte März veränderte sich das Umfeld, als die US-Notenbank das Rettungsprogramm "Bank Term Funding Program" ankündigte, nachdem die Silicon Valley Bank (SVB) und die Signature Bank in die Insolvenz gegangen waren. Beim ICE BofA 1-3 Year EU Corporate Index weiteten sich die Spreads in diesem Zeitraum um 44 Basispunkte aus.

Der Fonds hat die Rally im 4. Quartal 2022 genutzt, um das Kreditrisiko des Portfolios über eine Reduzierung des Engagements in Schwellenländeranleihen, Hochzinsanleihen und nachrangigen Anleihen zu verringern und sich in Erwartung günstigerer Einstiegspunkte im Jahr 2023 konservativer zu positionieren. Hierdurch wurde die Spread-Duration reduziert und das Risiko teilweise in liquidere Instrumente umgeschichtet, die von anhaltenden Zuflüssen in sichere Häfen profitieren dürften. Bezüglich des Engagements in Zinssätzen hatte der Fonds in der ersten Jahreshälfte 2022 eine kürzere Duration als die Benchmark und begann etwa ab dem 3. Quartal 2022, diese Lücke allmählich zu schliessen, und intensivierte diese Bemühungen im 1. Quartal 2023 bis zu einer neutralen Positionierung gegenüber der Benchmark. Die Rating- und Sektorverteilung war das Ergebnis unseres rigorosen Investment- und Kreditmanagementprozesses.

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

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund

Nach fast zwei Jahren von Problemen im Zusammenhang mit COVID-19 stieg die Inflation, die bereits 2021 aufgrund der jahrelangen extrem lockeren Geldpolitik und der Lieferkettenprobleme erste Spuren hinterliess, nach der Invasion Russlands in die Ukraine und den damit verbundenen Verwerfungen der Versorgung mit Energie und landwirtschaftlichen Erzeugnissen weiter an. Letztendlich haben alle grossen Zentralbanken mit der schwindenden Hoffnung, dass die Inflation nur vorübergehend sein könnte, begonnen, sehr schnell Ihre Leitzinsen anzuheben – und das mit ungewöhnlich grossen Schritten, die es seit mindestens zehn Jahren nicht mehr gegeben hat. Ungewissheit im Hinblick auf den Verlauf der Inflation, das Ausmass der geldpolitischen Straffung und letztendlich einer Rezession, die selbst verursachte Wachstumsschwäche Chinas in Verbindung mit zunehmenden geopolitischen Risiken belasteten die Stimmung der Anleger massiv und führten über den Berichtszeitraum zu einer weitgehenden Umschichtung in weniger risikoreiche Anlagen.

Das erste Quartal 2023 endete weitgehend im positiven Bereich, wengleich am Markt phasenweise ein hohes Mass an Volatilität herrschte. Noch Anfang März waren die Konjunkturdaten gut, die Inflation hielt sich weiter hartnäckig, der Tonfall des Fed-Vorsitzenden in seiner Rede vor dem Kongress war restriktiv und somit stiegen die Erwartungen im Hinblick auf den endgültigen Zinssatz der weltweiten Zentralbanken in ihrem Kampf zur Eindämmung der Inflation. Gegen Mitte März veränderte sich das Umfeld, als die US-Notenbank das Rettungsprogramm "Bank Term Funding Program" ankündigte, nachdem die Silicon Valley Bank (SVB) und die Signature Bank in die Insolvenz gegangen waren. Beim Liquid Swiss Index (A-Rating) verengten sich die Spreads über den Zeitraum um 19 Basispunkte.

Die Angaben und Renditen beziehen sich auf die abgelaufene Berichtsperiode und sind nicht maßgebend für zukünftige Erträge.

Der Fonds hat die Rally im 4. Quartal 2022 genutzt, um das Kreditrisiko des Portfolios über eine Reduzierung des Engagements in Schwellenländeranleihen, Hochzinsanleihen und nachrangigen Anleihen zu verringern und sich in Erwartung günstigerer Einstiegspunkte im Jahr 2023 konservativer zu positionieren. Hierdurch wurde die Spread-Duration reduziert und das Risiko teilweise in liquidere Instrumente mit höherem Rating umgeschichtet, die von anhaltenden Zuflüssen in sichere Häfen profitieren dürften. Bezüglich des Engagements in Zinssätzen hatte der Fonds im 2. und 3. Quartal 2022 eine kurze Duration im Vergleich zur Benchmark und begann im 4. Quartal 2022 und im 1. Quartal 2023 diese Lücke allmählich zu schliessen. Die Rating- und Sektorverteilung war das Ergebnis unseres rigorosen Investment- und Kreditmanagementprozesses.

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

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund

Nach fast zwei Jahren von Problemen im Zusammenhang mit COVID-19 stieg die Inflation, die bereits 2021 aufgrund der jahrelangen extrem lockeren Geldpolitik und der Lieferkettenprobleme erste Spuren hinterliess, nach der Invasion Russlands in die Ukraine und den damit verbundenen Verwerfungen der Versorgung mit Energie und landwirtschaftlichen Erzeugnissen weiter an. Letztendlich haben alle grossen Zentralbanken mit der schwindenden Hoffnung, dass die Inflation nur vorübergehend sein könnte, begonnen, sehr schnell Ihre Leitzinsen anzuheben – und das mit ungewöhnlich grossen Schritten, die es seit mindestens zehn Jahren nicht mehr gegeben hat. Ungewissheit im Hinblick auf den Verlauf der Inflation, das Ausmass der geldpolitischen Straffung und letztendlich einer Rezession, die selbst verursachte Wachstumsschwäche Chinas in Verbindung mit zunehmenden geopolitischen Risiken belasteten die Stimmung der Anleger massiv und führten über den Berichtszeitraum zu einer weitgehenden Umschichtung in weniger risikoreiche Anlagen.

Das erste Quartal 2023 endete weitgehend im positiven Bereich, wengleich am Markt phasenweise ein hohes Mass an Volatilität herrschte. Noch Anfang März waren die Konjunkturdaten gut, die Inflation hielt sich weiter hartnäckig, der Tonfall des Fed-Vorsitzenden in seiner Rede vor dem Kongress war restriktiv und somit stiegen die Erwartungen im Hinblick auf den endgültigen Zinssatz der weltweiten Zentralbanken in ihrem Kampf zur Eindämmung der Inflation. Gegen Mitte März veränderte sich das Umfeld, als die US-Notenbank das Rettungsprogramm "Bank Term Funding Program" ankündigte, nachdem die Silicon Valley Bank (SVB) und die Signature Bank in die Insolvenz gegangen waren. Beim ICE BofA 1-3 Year US Corporate Index weiteten sich die Spreads in diesem Zeitraum um 36 Basispunkte aus.

Der Fonds hat die Rally im 4. Quartal 2022 genutzt, um das Kreditrisiko des Portfolios über eine Reduzierung des Engagements in Schwellenländeranleihen, Hochzinsanleihen und nachrangigen Anleihen zu verringern und sich in Erwartung günstigerer Einstiegspunkte im Jahr 2023 konservativer zu positionieren. Hierdurch wurde die Spread-Duration reduziert und das Risiko teilweise in liquidere Instrumente umgeschichtet, die von anhaltenden Zuflüssen in sichere Häfen profitieren dürften. Bezüglich des Engagements in Zinssätzen hatte der Fonds im gesamten Jahr 2022 eine kürzere Duration als die Benchmark. Allerdings wurde diese Lücke ab dem 4. Quartal 2022 allmählich geschlossen, was im 1. Quartal 2023 bis zu einer neutralen Positionierung gegenüber der Benchmark beschleunigt wurde. Die Rating- und Sektorverteilung war das Ergebnis unseres rigorosen Investment- und Kreditmanagementprozesses.

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

Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund

2022 war das Jahr der Zinswende. Die Zentralbanken waren gezwungen, ihre Geldpolitik zu straffen, wodurch es zu schnell aufeinander folgenden Zinsanhebungen grösseren Umfangs kam, sodass die Ära niedriger und negativer Zinsen ein Ende hatte. Bei ihrer vierteljährlichen Einschätzung der Geldpolitik am 23. März 2023 hob die SNB ihren Leitzins zum vierten Mal in Folge um +50 Basispunkte auf dann 1,5% an. Ziel dieser Massnahme war es, dem erhöhten Inflationsdruck entgegenzuwirken. Stärkere Zweitrundeneffekte und höherer Inflationsdruck aus dem Ausland führten trotz einer Zinsanhebung zu einer etwas höheren Prognose als im Dezember.

Der Fonds hielt über den gesamten Berichtszeitraum an einer kurzen Realzinsduration fest, was nach dem starken Zinsanstieg im Jahr 2022 verringert wurde. Insgesamt war der Fonds in Unternehmensanleihen untergewichtet, was sich angesichts der durchschnittlichen Ausweitung der Spreads positiv auswirkte. Den grössten positiven Einfluss auf die Performance hatte jedoch die Inflationsabsicherung. Ein Inflations-Overlay hat zwei verschiedene Performancetreiber: die Entwicklung der Breakeven-Sätze und die realisierte Inflation. Die Breakeven-Sätze gingen im Allgemeinen zurück, um etwa 0,8% in USD und rund 0,6% in EUR (5-jährige Laufzeiten), was eine negative Auswirkung auf die Performance bedeutet. Doch insbesondere in Europa fiel die tatsächliche Inflation überraschend hoch aus, was zu einem positiven Performancebeitrag führte, der die negative Auswirkung der fallenden Breakeven-Sätze mehr als ausglich und für eine deutliche Outperformance gegenüber der (nominalen) Benchmark sorgte.

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

Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund

Der Krieg in Europa, Inflation praktisch auf der ganzen Welt, höhere Zinsen und zunehmende Rezessionsrisiken – selten hatte die Weltwirtschaft unter so vielen Schocks zu leiden wie 2022. In vielen Teilen der Welt kam es zum drastischsten Anstieg der Zinsen seit der Ölkrise in den 1970er Jahren. In die Höhe schnellende Energie- und Lebensmittelpreise trafen die Wirtschaft in Europa hart, besonders in Deutschland. Das Verbrauchervertrauen in der Eurozone brach in einem Ausmass ein, das es selten gegeben hat. China begann, seine strikte Null-COVID-Politik als Reaktion auf öffentliche Proteste im Dezember zu lockern, und verzeichnete erneut einen schnell Anstieg der Fallzahlen zum Jahresende. Die bedeutendsten wirtschaftlichen Frühindikatoren deuten weiter auf Rezessionsrisiken hin.

Das prägendste Merkmal des 1. Quartals 2023 war die Umsetzung einer restriktiven Geldpolitik durch viele Zentralbanken zur Bekämpfung der beständig hohen Inflation, die in vielen Ländern noch über den Zielen der jeweiligen Zentralbanken liegt. Zu Jahresbeginn war das geopolitische Umfeld von einem verheerenden Erdbeben in der Türkei und Syrien und den in der Ukraine wütenden Krieg gekennzeichnet. Das Wachstum der Weltwirtschaft stagnierte im letzten Quartal 2022 nahezu, aber das Worst-Case-Szenario von Stromausfällen im Winter konnte verhindert werden, was zum Teil einem klein wenig Glück in Form von mildem Wetter in Europa zu verdanken war. Bei den Leitzinsen wurden die Zügel erheblich und schnell angezogen, was die Gefahr einer Rezession erhöhte und Befürchtungen im Hinblick auf die Stabilität des Bankensystems auslöste. Der daraus resultierende Vertrauensverlust und eine Kombination anderer unglücklicher Umstände führten zu einer Bankenkrise in den USA und auch in der Schweiz. Aufsichtsbehörden, Zentralbanken und Regierungen sahen sich gezwungen, schnell mit Unterstützungspaketen einzuschreiten. Anhaltende weltweite Ungewissheit löste erhöhte Volatilität an den Finanzmärkten aus.

Die Schweizer Wirtschaft trat Ende 2022 auf der Stelle. Das Schweizer BIP blieb im vierten Quartal unverändert (+0,8% im Jahresvergleich), nachdem es im vorangegangenen Quartal um 0,2% gewachsen war. Im Gesamtjahr 2022 lag das Wachstum mit 2,1% jedoch erneut über dem Durchschnitt, was durch die Binnennachfrage und die Wiederbelebung des Sektors personenbezogener Dienstleistungen nach der Pandemie unterstützt wurde. Der Industriesektor bremste im 4. Quartal die Wirtschaft. Die Exporte gingen angesichts der Schwäche des internationalen Umfelds zurück. Frühindikatoren deuten auf ein solides Wachstum der Schweizer Wirtschaft im Jahr 2023 hin. Die Beschäftigung hat erneut deutlich zugenommen und die Arbeitslosenquote lag im März 2023 auf dem niedrigsten Stand seit 2001. Die Energiekrise hat die Wirtschaft dank eines milden Winters weniger stark belastet als befürchtet, wenngleich die Wirtschaftsdynamik unter steigenden Zinsen und anhaltend hoher Inflation leidet. Der jüngste Anstieg der Verbraucherpreise scheint nun an breiter Front zum Tragen zu kommen und auch die Kerninflation liegt deutlich über dem Ziel der SNB.

2022 war das Jahr der Zinswende. Die Zentralbanken waren gezwungen, ihre Geldpolitik zu straffen, wodurch es zu schnell aufeinander folgenden Zinsanhebungen grösseren Umfangs kam, sodass die Ära niedriger und negativer Zinsen ein Ende hatte. Bei ihrer vierteljährlichen Einschätzung der Geldpolitik am 23. März 2023 hob die SNB ihren Leitzins zum vierten Mal in Folge um +50 Basispunkte auf dann 1,5% an (was einer Erhöhung um insgesamt 225 Basispunkte seit Juni 2022 entspricht). Ziel dieser Massnahme war es, dem erhöhten Inflationsdruck entgegenzuwirken. Die SNB schliesst weitere Zinsanhebung zur Gewährleistung der mittelfristigen Preisstabilität nicht aus. Die Bank wies auch darauf hin, dass sie bereit sei, bei Bedarf aktiv Massnahmen auf dem Devisenmarkt zu ergreifen, um für angemessene geldpolitische Bedingungen zu sorgen. Der Verkauf von Fremdwährungen steht seit nunmehr mehreren Quartalen im Mittelpunkt der Aufmerksamkeit. Die Inflation ist seit Jahresbeginn erneut gestiegen und liegt derzeit auf einem Niveau, das deutlich über der Bandbreite liegt, die die SNB mit Preisstabilität gleichsetzt. Stärkere Zweitundeneffekte und höherer Inflationsdruck aus dem Ausland führten trotz einer Zinsanhebung zu einer etwas höheren Prognose als im Dezember. In ihrem Basisszenario geht die SNB von einem flauen Wirtschaftswachstum bei vorübergehend anhaltend hoher weltweiter Inflation aus. Die SNB erwartet auch für die Schweiz ein mässiges Wachstum im Jahr 2023, das von einer schleppenden Auslandsnachfrage und realen Verlusten von Kaufkraft gedämpft wird.

Die internationalen Finanzmärkte waren von der Inflationsentwicklung und den damit verbundenen Erwartungen für die Geldpolitik geprägt. 2022 war ein brutales Jahr für die Anleihenmärkte, in dem Anleger aufgrund von anhaltender Inflation, Renditeanstiegen, hoher Volatilität und steigenden Risikoaufschlägen vor dem Hintergrund einer drohenden Rezession massive Verluste hinnehmen mussten. Das Geschehen auf den weltweiten Finanzmärkten war im ersten Quartal 2023 von den Inflationsentwicklungen und den damit verbundenen Zinsanhebungen durch zahlreiche Zentralbanken geprägt. Ab Mitte März führten die Turbulenzen im internationalen Finanzsektor zu einem erheblichen Anstieg der Volatilität und der Flucht von Anlegern in sichere Häfen. Die Renditen auf 10-jährige Staatsanleihen schwankten in den Industrieländern während des Berichtszeitraums sehr stark.

Die Rendite auf 10-jährige Schweizer Staatsanleihen stieg um +61 Basispunkte und tendierte in einem Bereich von 0,34% bis 1,62%. Die Kurve hat sich mittlerweile deutlich abgeflacht und die Renditen liegen bei allen Laufzeiten bei etwa 1,2%. Bei den längsten Laufzeiten waren die stärksten Verluste zu verzeichnen. Anleihen der Schweizerischen Eidgenossenschaft verzeichneten eine Outperformance gegenüber Swap-Proxy-Emittenten. Swap-Spreads weiteten sich aufgrund der Risikoaversion und der Flucht in sichere Anlagen aus, während sich die Kreditspreads wegen der Illiquidität des Marktes und des Mangels an Anlagemöglichkeiten in Schweizer Franken verengten.

In diesem Umfeld wurden über den Berichtszeitraum die Risiken des Fonds verringert und stärker diversifiziert. In Erwartung steigender Zinsen wurde die Duration reduziert. Positive Beiträge zur relativen Performance stammten von der kürzeren Duration und der Positionierung auf der Kurve sowie von der Sektorallokation mit der Untergewichtung in Covered Bonds und Emissionen aus dem Finanzsektor.

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	EUR	1498937	LU0155950867	0,60%	0,82%
B - Thesaurierend	EUR	1498940	LU0155951089	0,60%	0,82%
DB - Thesaurierend	EUR	1571278	LU0164804014	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	EUR	23527497	LU1024300342	0,25%	0,43%
EB - Thesaurierend	EUR	11660344	LU0535913296	0,25%	0,43%
IB - Thesaurierend	EUR	1498943	LU0155951329	0,30%	0,52%
MB - Thesaurierend	EUR	14990630	LU0747630571	0,20%	0,38%
UA - Ausschüttend	EUR	26362610	LU1144399323	0,45%	0,67%
UB - Thesaurierend	EUR	26362631	LU1144399596	0,45%	0,67%

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die -DB- Aktien.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	EUR	0,78%	/	-6,77%	-0,60%	0,61%
B - Thesaurierend	EUR	0,78%	/	-6,77%	-0,59%	0,61%
DB - Thesaurierend	EUR	0,96%	/	-6,12%	0,09%	1,29%
EA - Ausschüttend	EUR	0,88%	/	-6,41%	-0,21%	1,00%
EB - Thesaurierend	EUR	0,88%	/	-6,41%	-0,21%	1,00%
IB - Thesaurierend	EUR	0,86%	/	-6,49%	-0,30%	0,91%
MB - Thesaurierend	EUR	0,89%	/	-6,36%	-0,16%	1,05%
UA - Ausschüttend	EUR	0,82%	/	-6,64%	-0,44%	0,75%
UB - Thesaurierend	EUR	0,83%	/	-6,64%	-0,44%	0,75%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	EUR	17.05.2022	0,91
EA - Ausschüttend	EUR	17.05.2022	13,69
UA - Ausschüttend	EUR	17.05.2022	1,15

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In EUR)
USD	150.000	EUR	-141.421	28.04.2023	-3.577,03
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
EUR	31.355.000	USD	-33.800.000	28.04.2023	294.603,37
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
USD	5.500.000	EUR	-5.154.422	28.04.2023	-100.138,79
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
USD	4.300.000	EUR	-4.025.610	28.04.2023	-74.080,02
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften

116.807,53

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

		31.03.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		384.515.678,95			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		114.890,95			
Forderungen aus Erträgen		2.844.867,83			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		116.807,53			
		387.592.245,26			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		164.405,74			
		164.405,74			
Nettovermögen		387.427.839,52			
Fondsentwicklung					
		31.03.2023	31.03.2022	31.03.2021	
Fondsvermögen	EUR	387.427.839,52	480.738.448,62	497.544.212,38	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	EUR	74,05	77,29	81,18	
B - Thesaurierend	EUR	122,58	126,40	130,97	
DB - Thesaurierend	EUR	980,61	1.004,11	1.033,19	
EA - Ausschüttend	EUR	834,69	871,30	915,17	
EB - Thesaurierend	EUR	1.016,42	1.044,12	1.077,60	
IB - Thesaurierend	EUR	999,53	1.027,67	1.061,56	
MB - Thesaurierend	EUR	960,21	985,88	1.016,98	
UA - Ausschüttend	EUR	83,18	86,81	91,18	
UB - Thesaurierend	EUR	95,32	98,15	101,54	
Anzahl der Anteile im Umlauf					
		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	EUR	89.589,827	112.019,238	1.133,344	23.562,755
B - Thesaurierend	EUR	359.662,578	488.594,796	27.873,246	156.805,464
DB - Thesaurierend	EUR	45.582,615	68.722,399	11.375,133	34.514,917
EA - Ausschüttend	EUR	4.139,032	3.977,916	1.204,802	1.043,686
EB - Thesaurierend	EUR	145.092,433	171.424,135	39.348,502	65.680,204
IB - Thesaurierend	EUR	21.762,274	34.097,808	597,655	12.933,189
MB - Thesaurierend	EUR	113.178,659	113.178,659	0,000	0,000
UA - Ausschüttend	EUR	17.954,534	22.072,613	2.050,000	6.168,079
UB - Thesaurierend	EUR	96.089,096	105.196,915	41.646,520	50.754,339

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in EUR)Für die Periode vom
01.04.2022 bis zum
31.03.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	480.738.448,62
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	7.644.743,16
Bankzinsen	22.787,04
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	110.001,00
	7.777.531,20
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.172.330,78
Depotbank- und Depotgebühr	250.281,33
Zentralverwaltungsvergütung	265.091,40
Druck- und Veröffentlichungskosten	30.824,13
Zinsen und Bankspesen	12.389,69
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	156.135,14
"Taxe d'abonnement"	73.748,58
	1.960.801,05
Nettoerträge (-verluste)	5.816.730,15
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-5.766.081,06
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-37.300,00
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	5.439.462,66
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-12.639.731,83
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-1.204.476,67
	-14.208.126,90
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-8.391.396,75
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-4.710.285,77
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-3.223.418,14
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	3.795.854,81
	-4.137.849,10
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-12.529.245,85
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	60.228.167,57
Rücknahmen	-140.832.387,80
	-80.604.220,23
Ausschüttung	-177.143,02
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	387.427.839,52

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	19,51
Frankreich	13,80
Niederlande	13,19
Grossbritannien	10,15
Deutschland	9,88
Italien	4,76
Japan	4,14
Irland	3,75
Dänemark	3,50
Spanien	2,60
Schweiz	1,96
Luxemburg	1,52
Kanada	1,49
Mexiko	1,32
Supranational	1,21
Jersey	1,11
Norwegen	1,09
Vereinigte Arabische Emirate	1,04
Österreich	0,98
Peru	0,84
Belgien	0,72
Kaimaninseln	0,46
Schweden	0,23
Total	99,25

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	44,72
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	25,26
Länder und Zentralregierungen	3,64
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	3,58
Tabak und alkoholische Getränke	3,23
Energie- und Wasserversorgung	2,73
Telekommunikation	2,19
Petroleum	1,99
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,81
Fahrzeuge	1,62
Chemie	1,38
Grafikverlags- und Druckmedien	1,21
Supranationale Organisationen	1,21
Elektrische Geräte und Komponenten	0,99
Versicherungsgesellschaften	0,77
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,70
Baustoffe und Bauindustrie	0,50
Elektronik und Halbleiter	0,37
Gesundheits- und Sozialdienste	0,36
Verschiedene Konsumgüter	0,35
Immobilien	0,22
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	0,22
Verpackungsindustrie	0,21
Total	99,25

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
EUR ABBVIE INC 1.25%/20-010624	4.500.000	4.366.960,00	1,13
EUR ABN AMRO BANK NV 1.25%/20-280525	4.500.000	4.272.615,00	1,10
USD AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.75%/21-291024	5.000.000	4.295.227,58	1,11
USD AFRICA FINANCE CORP 3.125%/20-16.06.2025	5.500.000	4.688.503,84	1,21
EUR AIB GROUP PLC FF FRN/22-040726	3.350.000	3.292.112,00	0,85
EUR ALLIANZ SE FIX-TO-FRN (SUBORDINATED) 6.25%13-PERPETUAL	3.000.000	2.997.570,00	0,77
USD ALLY FINANCIAL INC 1.45%/20-02.10.2023	650.000	560.916,75	0,15
EUR AMCO SPA 2.25%/20-17.07.2027	2.000.000	1.825.480,00	0,47
EUR ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.625%/19-110326	3.000.000	2.816.730,00	0,73
EUR AROUNDTOWN SA 1%/17-07.01.2025	1.000.000	835.100,00	0,22
EUR ASAHJ GROUP HOLDINGS 1.151%/17-190925	2.000.000	1.889.280,00	0,49
EUR ASAHJ GROUP HOLDINGS LTD 0.01%/21-190424	3.500.000	3.367.910,00	0,87
EUR ASTRAZENECA 0.75%/16-120524	2.000.000	1.949.960,00	0,50
EUR AT&T 3.5%/13-17.12.2025	3.000.000	2.997.060,00	0,77
USD BANCO DE CREDITO DEL PER 2.7%/19-11.01.2025	1.500.000	1.320.626,81	0,34
EUR BANCO SANTANDER SA 1.125%/18-170125	200.000	190.860,00	0,05
EUR BANCO SANTANDER SA 1.375%/20-050126	1.500.000	1.399.545,00	0,36
EUR BANCO SANTANDER SA 3.75%/23-160126	3.000.000	3.002.460,00	0,77
EUR BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-09.05.2026	3.500.000	3.272.955,00	0,84
EUR BANK OF AMERICA FF 1.379%/17-070225	4.000.000	3.914.160,00	1,01
EUR BANK OF IRELAND FF FRN/22-050626	2.000.000	1.891.900,00	0,49
EUR BANK OF IRELAND GROUP FIX-TO-FRN FRN/19-08.07.2024	2.000.000	1.981.740,00	0,51
EUR BARCLAYS FF 1.375%/18-240126	4.500.000	4.260.060,00	1,10
EUR BARCLAYS PLC FF FRN/20-020425	2.000.000	1.983.680,00	0,51
EUR BAYER AG 0.375%/20-06.07.2024	3.500.000	3.363.465,00	0,87
USD BBVA BANCOMER SA TEXAS 1.875%/20-18.09.2025	1.150.000	967.833,31	0,25
EUR BECTON DICKINSON AND CO 0.034%/21-130825	1.000.000	923.080,00	0,24
EUR BERRY GLOBAL INC 1%/20-15.01.2025	1.000.000	950.710,00	0,25
EUR BEYCO LUX SARL 1.5%/20-16.09.2027	3.500.000	3.129.210,00	0,81
EUR BFCM 3%/13-281123	2.000.000	1.994.400,00	0,51
EUR BFCM REG S S 405 1.25%/15-140125	4.500.000	4.304.250,00	1,11
EUR BNP PARIBAS FF FRN/19-230127	5.000.000	4.717.650,00	1,22
EUR BNP PARIBAS FIX-TO-FRN FRN/19-15.07.2025	3.000.000	2.867.940,00	0,74
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	2.000.000	1.850.740,00	0,48
EUR BPCE SA 1.375%/18-23.03.2026	2.000.000	1.860.460,00	0,48
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0%/20-151127	4.500.000	4.051.215,00	1,05
EUR CAIXABANK SA 0.625%/19-01.10.2024	1.000.000	954.060,00	0,25
EUR CAIXABANK SA 1.375%/19-190626	3.000.000	2.755.800,00	0,71
EUR CANADIAN IMPERIAL BANK 0.375%/19-03.05.2024	3.000.000	2.890.260,00	0,75
EUR CARLSBERG BREWERIES REG S 2.5%/14-280524	2.000.000	1.975.200,00	0,51
EUR CCEP FINANCE IRELAND DAC 0%/21-060925	2.350.000	2.156.689,00	0,56
EUR CELANESE US 4.777%/22-190726	2.000.000	1.971.980,00	0,51
EUR CELLNEX FINANCE CO SA 0.75%/21-15.11.2026	2.000.000	1.769.860,00	0,46
EUR CITIGROUP 1.75%/15-280125	3.000.000	2.906.160,00	0,75
EUR CITIGROUP INC FF FRN/18-240726	1.200.000	1.129.848,00	0,29
EUR CITIGROUP INC FF FRN/20-060726	4.000.000	3.753.760,00	0,97
EUR CNH INDUSTRIAL FIN EUR S 1.875%/190126	2.000.000	1.923.400,00	0,50
EUR COCA-COLA HBC FIN 2.75%/22-230925	2.500.000	2.469.750,00	0,64
EUR COMMERZBANK AG 1.125%/17-240524	1.500.000	1.455.930,00	0,38
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.625%/19-27.02.2024	1.800.000	1.751.506,00	0,45
EUR CREDIT AGRICOLE LONDON 1%/17-160924	3.000.000	2.881.680,00	0,74
EUR CREDIT AGRICOLE LONDON 1.375%/18-130325	5.500.000	5.271.310,00	1,36
EUR CREDIT AGRICOLE SA FF FRN/22-121026	3.500.000	3.496.990,00	0,90
EUR CREDIT SUISSE GROUP FINANCE FIX-TO-FRN 1.25%/17-17.07.2025	2.000.000	1.872.740,00	0,48
EUR DANONE FF 1.75%/17-PERPET	1.900.000	1.889.075,00	0,49
EUR DANSKE BANK A/S FF FRN/22-170227	3.500.000	3.210.060,00	0,83
EUR DANSKE BANK A/S FIX-TO-FRN FRN/19-27.08.2025	2.000.000	1.895.880,00	0,49
EUR DELPHI AUTOMOTIVE 1.5%/15-10.03.2025	1.500.000	1.436.160,00	0,37
EUR DEUTSCHE BAHN FIN GMBH SUB FF FRN/19-PER	4.800.000	4.459.488,00	1,15
EUR DEUTSCHE BANK AG FF FRN/20-191125	5.000.000	4.626.150,00	1,19
EUR DISCOVERY COMMUNICATIONS 1.9%/15-190327	2.500.000	2.299.675,00	0,59
EUR DNB BANK ASA FF FRN/22-310526	2.000.000	1.910.040,00	0,49
EUR E.ON SE 1%/20-07.10.2025	3.000.000	2.841.960,00	0,73
EUR EDP FINANCE 2%/15-22.04.2025	2.000.000	1.953.420,00	0,50
USD EDP FINANCE BV 3.625%/17-150724	1.500.000	1.351.346,13	0,35
EUR ELECTRICITE DE FRANCE 3.875%/22-120127	3.400.000	3.412.614,00	0,88
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	1.500.000	1.442.340,00	0,37
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL N.V. 2.65%/19-10.09.2024	2.000.000	1.776.317,36	0,46
EUR ENEL FINANCE INTL 0.25%/22-171125	2.500.000	2.305.600,00	0,60
EUR ENGIE SA 1.375%/20-270325	3.000.000	2.885.010,00	0,74
EUR ENI SPA SUB FF FRN/20-PERPET	3.000.000	2.771.850,00	0,72
EUR EUROCLEAR BANK SA 0.125%/20-07.07.2025	3.000.000	2.794.890,00	0,72
EUR FCA BANK SPA IRELAND 0.5%/19-130924	4.500.000	4.277.700,00	1,10
EUR FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 3.875%/20-05.01.2026	2.000.000	2.008.380,00	0,52
EUR FIRST ABU DHABI BANK PJS 0.125%/21-16.02.2026	4.500.000	4.042.170,00	1,04
EUR GENERAL ELECTRIC CO 0.875%/17-170525	2.000.000	1.892.440,00	0,49

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

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
EUR GENERAL MOTORS FINANCIAL 0.955%/16-07.09.2023	1.750.000	1.731.170,00	0,45
EUR GERMANY 0.50%/16-150226	5.500.000	5.203.000,00	1,34
EUR GERMANY 1%/15-150825	3.000.000	2.890.725,00	0,75
EUR GLAXOSMITHKLINE CAPITAL S 8 4%/05-160625	2.500.000	2.541.800,00	0,66
EUR GLENCORE FINANCE (EUROPE) 1.75%/15-17.03.2025	3.000.000	2.879.340,00	0,74
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.375%/17-150524	2.000.000	1.951.500,00	0,50
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.375%/20-270325	4.000.000	3.976.360,00	1,03
EUR GRENKE FINANCE PLC 0.625%/19-090125	1.000.000	895.180,00	0,23
EUR GSK CONSUMER HEALTHCARE 1.25%/22-290326	1.500.000	1.395.960,00	0,36
EUR HARLEY-DAVIDSON FIN SER 3.875%/20-190523	2.000.000	1.999.800,00	0,52
EUR HARLEY-DAVIDSON FINL SER 0.9%/19-19.11.2024	1.500.000	1.430.475,00	0,37
EUR HEIDELBERGCEMENT (REG -S-) 1.5%/16-07.02.2025	2.000.000	1.918.060,00	0,50
EUR HEIMSTADEN BOSTAD 0.25%/21-131024	2.500.000	2.263.125,00	0,58
EUR HSBC HOLDINGS PLC S 36 FF FRN/18-041224	3.500.000	3.448.830,00	0,89
EUR IBERDROLA INTL BV (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	2.000.000	1.926.980,00	0,50
EUR INFINEON TECHNO AG SUB FF FRN/19-PERPET	1.500.000	1.427.385,00	0,37
EUR INFORMA PLC 2.125%/20-061025	2.500.000	2.386.500,00	0,62
EUR ING GROEP NV FF FRN/21-291125	6.000.000	5.609.940,00	1,45
EUR ING GROEP NV FF FRN/22-160227	2.000.000	1.835.020,00	0,47
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/19-041224	5.000.000	4.757.600,00	1,23
EUR JP MORGAN CHASE 0.625%/16-250124	2.000.000	1.952.020,00	0,50
EUR JP MORGAN CHASE S. -83- (REG. -S-) 1.5%/15-27.01.2025	1.500.000	1.448.880,00	0,37
EUR JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/19-11.03.2027	4.500.000	4.142.025,00	1,07
EUR JYSKE BANK A/S FIX-TO-FRN FRN/20-15.10.2025	4.000.000	3.774.240,00	0,97
EUR KFW 0.375%/18-230425	3.000.000	2.848.350,00	0,74
EUR LLOYDS BANKING FRN 18-070928	1.000.000	983.600,00	0,25
EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN/20-010426	2.000.000	1.979.140,00	0,51
EUR LONDON STOCK EXCHANGE 0.875%/17-190924	3.000.000	2.886.270,00	0,74
USD MATTEL INC 5.875%/19-15.12.2027	1.500.000	1.374.968,94	0,35
EUR MITSUBISHI UFJ FIN FF FRN/22-190925	3.000.000	2.947.830,00	0,76
EUR MITSUBISHI UFJ FIN GRP INC 0.339%/190724	3.200.000	3.055.104,00	0,79
EUR MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.956%/17-16.10.2024	5.000.000	4.780.200,00	1,23
EUR MOLSON COORS BREWING 1.25%/16-15.07.2024	5.500.000	5.309.700,00	1,37
EUR MORGAN STANLEY 1.75%/15-30.01.2025	3.000.000	2.908.320,00	0,75
EUR MORGAN STANLEY FF FRN/21-291027	2.000.000	1.750.300,00	0,45
EUR MORGAN STANLEY FF FRN/22-080526	4.500.000	4.320.360,00	1,12
EUR NATWEST MARKETS PLC 0.125%/21-121125	6.500.000	5.897.320,00	1,52
EUR NYKREDIT REALKREDIT AS 0.25%/20-13.01.2026	3.000.000	2.700.930,00	0,70
EUR OMY AG SUB FF FRN/18-PERPET	2.000.000	1.940.040,00	0,50
EUR ORANGE FF 5.25%/14-PERPET	3.000.000	3.001.920,00	0,77
EUR PEUGEOT SA 2%/18-20.03.2025	2.000.000	1.944.320,00	0,50
USD PROSUS N.V. 3.257%/22-190127	1.000.000	839.541,63	0,22
EUR PROSUS NV 1.207%/22-190126	2.000.000	1.793.520,00	0,46
USD ONB FINANCE LTD 1.625%/20-22.09.2025	2.100.000	1.785.130,47	0,46
EUR RCI BANQUE 1.625%/17-11.04.2025	2.500.000	2.375.225,00	0,61
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE FIX-TO-FRN (REG. -S-) (SUBORDINATED) 15-25.03.2075	2.000.000	1.946.900,00	0,50
EUR REPUBLIC OF PERU 2.75%/15-30.01.2026	2.000.000	1.939.100,00	0,50
EUR ROYAL BANK OF CANADA 0.125%/19-23.07.2024	3.000.000	2.864.670,00	0,74
EUR ROYAL FRIESLANDCAMPINA SUB FF FRN/20-PER 2.85%/20-10.12.2169	1.100.000	1.002.353,00	0,26
EUR SANOFI 0.875%/22-060425	3.000.000	2.870.220,00	0,74
EUR SANTANDER 0.5%/22-110825	2.500.000	2.302.975,00	0,59
EUR SIEMENS FINAN 2.25%/22-100325	3.000.000	2.945.190,00	0,76
EUR SIGMA ALIMENT REG S 2.625%/17-070224	4.200.000	4.140.234,00	1,07
USD SILGAN HOLDINGS INC 1.4%/21-01.04.2026	1.000.000	828.726,59	0,21
EUR SOCIETE GENERALE 1.25%/19-150224	1.500.000	1.467.285,00	0,38
EUR SOCIETE GENERALE FF FRN/20-210426	4.000.000	3.747.560,00	0,97
EUR STANDARD CHARTERED (SUBORDINATED) (REG. -S-) 3.125%/14-19.11.2024	2.000.000	1.970.640,00	0,51
USD SUZANO AUSTRIA (REG. -S-) 5.75%/16-14.07.2026	2.000.000	1.848.368,54	0,48
EUR SYNGENTA FINANCE NV 3.375%/20-160426	2.000.000	1.944.520,00	0,50
EUR TELFONICA DEUTSCH FINAN 1.75%/18-05.07.2025	200.000	191.010,00	0,05
EUR TESCO CORP TREASURY SERV 1.375%/18-24.10.2023	2.000.000	1.977.360,00	0,51
EUR TOTAL (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2.708%/16-PERPETUAL	3.000.000	2.996.370,00	0,77
EUR UBS GROUP AG FF FRN/20-290126	2.000.000	1.842.200,00	0,48
EUR UBS GROUP FD SWITZERLAND FF 18-170425	4.000.000	3.859.760,00	1,00
EUR UNICREDIT SPA FF FRN/19-250625	5.000.000	4.826.550,00	1,25
EUR UPJOHN FINANCE BV 1.023%/20-23.06.2024	5.500.000	5.307.555,00	1,37
EUR VERIZON COMMUNICATIONS 3.25%/14-170226	2.500.000	2.484.050,00	0,64
EUR VOLKSWAGEN INTL FIN 3.125%/22-280325	1.500.000	1.481.175,00	0,38
EUR VOLVO TREASURY AB 0%/21-180526	1.000.000	897.210,00	0,23
EUR WELLS FARGO & COMPANY FIX-TO-FRN FRN/20-04.05.2025	6.000.000	5.820.600,00	1,50
EUR WPP FINANCE 1.375%/18-200325	2.500.000	2.384.400,00	0,62
EUR ZF EUROPE FINANCE BV 1.25%/19-23.10.2023	1.000.000	982.480,00	0,25
Total Anleihen		383.329.322,95	98,94
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		383.329.322,95	98,94

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
EUR ABBVIE INC 1.5%/20-151123	1.200.000	1.186.356,00	0,31
Total Anleihen		1.186.356,00	0,31
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Total des Wertpapierbestandes		384.515.678,95	99,25
Bareinlagen bei Banken und Brokern		114.890,95	0,03
Andere Nettovermögenswerte		2.797.269,62	0,72
Fondsvermögen		387.427.839,52	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	CHF	1498944	LU0155951675	0,50%	0,73%
B - Thesaurierend	CHF	1498946	LU0155952053	0,50%	0,73%
DB - Thesaurierend	CHF	31017122	LU1344630402	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	CHF	23529637	LU1024300938	0,20%	0,40%
EB - Thesaurierend	CHF	11660395	LU0535913619	0,20%	0,39%
IB - Thesaurierend	CHF	1498948	LU0155952566	0,22%	0,46%
UA - Ausschüttend	CHF	26364770	LU1144399679	0,30%	0,53%
UB - Thesaurierend	CHF	26364961	LU1144399752	0,30%	0,53%

Es gibt keine Verwaltungsgebühr für die -DB- Aktien.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	CHF	0,10%	/	-4,87%	-0,75%	-0,34%
B - Thesaurierend	CHF	0,09%	/	-4,88%	-0,75%	-0,34%
DB - Thesaurierend	CHF	0,26%	/	-4,30%	-0,16%	0,24%
EA - Ausschüttend	CHF	0,18%	/	-4,55%	-0,42%	0,00%
EB - Thesaurierend	CHF	0,19%	/	-4,55%	-0,42%	0,00%
IB - Thesaurierend	CHF	0,17%	/	-4,62%	-0,48%	-0,07%
UA - Ausschüttend	CHF	0,15%	/	-4,68%	-0,56%	-0,15%
UB - Thesaurierend	CHF	0,16%	/	-4,69%	-0,56%	-0,14%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	CHF	17.05.2022	0,25
EA - Ausschüttend	CHF	17.05.2022	5,86
UA - Ausschüttend	CHF	17.05.2022	0,46

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In CHF)
CHF	934.975	EUR	-950.000	28.04.2023	-6.574,76
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	5.702.694	USD	-6.250.000	28.04.2023	10.365,54
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	16.459.687	EUR	-16.700.000	28.04.2023	-91.729,35
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-87.938,57

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

		31.03.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		273.289.737,73			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		18.285.721,47			
Forderungen aus Erträgen		1.305.376,20			
		292.880.835,40			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		106.876,86			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		87.938,57			
		194.815,43			
Nettovermögen		292.686.019,97			
Fondsentwicklung		31.03.2023	31.03.2022	31.03.2021	
Fondsvermögen	CHF	292.686.019,97	334.641.188,86	372.426.181,91	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	CHF	78,79	80,42	84,02	
B - Thesaurierend	CHF	108,17	110,07	114,42	
DB - Thesaurierend	CHF	982,66	993,74	1.026,74	
EA - Ausschüttend	CHF	866,79	884,85	924,51	
EB - Thesaurierend	CHF	987,77	1.001,65	1.037,70	
IB - Thesaurierend	CHF	1.011,46	1.026,34	1.063,96	
UA - Ausschüttend	CHF	86,36	88,15	92,11	
UB - Thesaurierend	CHF	93,90	95,35	98,92	
Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	CHF	233.129,060	196.030,049	61.046,180	23.947,169
B - Thesaurierend	CHF	474.648,565	541.802,970	17.842,430	84.996,835
DB - Thesaurierend	CHF	110.785,459	115.841,425	43.064,982	48.120,948
EA - Ausschüttend	CHF	2.173,671	718,671	1.739,000	284,000
EB - Thesaurierend	CHF	48.631,786	73.581,931	5.497,526	30.447,671
IB - Thesaurierend	CHF	56.535,162	57.148,258	2.743,338	3.356,434
UA - Ausschüttend	CHF	33.848,433	33.544,164	7.872,866	7.568,597
UB - Thesaurierend	CHF	43.485,284	85.745,632	9.445,100	51.705,448

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in CHF)Für die Periode vom
01.04.2022 bis zum
31.03.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	334.641.188,86
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.929.471,82
Bankzinsen	34.988,20
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	33.718,96
	2.998.178,98
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	694.413,50
Depotbank- und Depotgebühr	167.300,97
Zentralverwaltungsvergütung	137.819,11
Druck- und Veröffentlichungskosten	19.470,43
Zinsen und Bankspesen	29.129,56
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	88.005,25
"Taxe d'abonnement"	75.422,12
	1.211.560,94
Nettoerträge (-verluste)	1.786.618,04
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-7.752.809,56
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	450.538,76
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	441.870,19
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	347.999,32
	-6.512.401,29
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-4.725.783,25
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	1.387.796,13
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-1.408.047,62
	-20.251,49
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-4.746.034,74
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	60.427.961,67
Rücknahmen	-97.569.348,49
	-37.141.386,82
Ausschüttung	-67.747,33
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	292.686.019,97

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Schweiz	16,88
Vereinigte Staaten	10,48
Frankreich	8,27
Grossbritannien	7,56
Kanada	5,63
Niederlande	5,29
Deutschland	5,02
Spanien	3,77
Österreich	3,60
Chile	3,55
Supranational	3,29
Südkorea	2,80
Bermudas	2,61
Neuseeland	2,33
Norwegen	1,97
Australien	1,80
Finnland	1,32
Luxemburg	1,30
Jersey	1,17
Vereinigte Arabische Emirate	1,00
Schweden	0,98
Irland	0,86
Mexiko	0,81
Polen	0,64
Belgien	0,33
Dänemark	0,12
Island	0,00
Total	93,37

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	53,24
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	17,73
Telekommunikation	4,94
Supranationale Organisationen	3,29
Energie- und Wasserversorgung	3,04
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,68
Verkehr und Transport	1,50
Beherbungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	1,50
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,34
Einzelhandel und Warenhäuser	1,34
Luft- und Raumfahrtindustrie	1,17
Gesundheits- und Sozialdienste	0,87
Diverse Dienstleistungen	0,80
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,34
Anlagefonds	0,30
Immobilien	0,28
Total	93,37

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	2.000.000	1.999.000,00	0,68
CHF AFRICA FINANCE CORP 1.205%/20-30.09.2025	3.000.000	2.850.000,00	0,97
CHF ALPIQ HOLDING AG 1.75%/22-240626	3.000.000	2.916.000,00	1,00
CHF AMAG LEASING AG 0.525%/21-271026	2.640.000	2.449.920,00	0,84
CHF AMAG LEASING AG 0.875%/17-251024	2.000.000	1.939.000,00	0,66
CHF ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 0.25%/16-25.10.2023	3.000.000	2.967.900,00	1,01
CHF AROUNDTOWN SA 0.732%/18-300125	1.000.000	930.000,00	0,28
CHF ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025	4.000.000	3.845.000,00	1,31
CHF AT&T 1.875%/14-04.12.2024	4.000.000	3.954.000,00	1,35
CHF BANC CREDITO INVERSIONES 0.4%/19-221124	4.000.000	3.844.000,00	1,31
CHF BANCO BILBAO SA 2.4075%/22-281125	2.000.000	1.996.000,00	0,68
CHF BANCO MERCANTIL DE NORTE 0.45%/19-18.12.2023	1.000.000	977.800,00	0,33
CHF BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024	1.470.000	1.385.475,00	0,47
CHF BANCO SANTANDER CHILE 0.384%/19-270924	1.000.000	966.500,00	0,33
CHF BANCO SANTANDER SA 0.75%/17-12.06.2023	2.000.000	1.995.600,00	0,68
CHF BANCO SANTANDER SA 1%/18-101224	2.000.000	1.949.000,00	0,67
CHF BANK OF AMERICA CORP 0.2525%/19-12.06.2026	4.000.000	3.762.000,00	1,29
EUR BANKIA SA SUB FF FRN/19-150229	1.000.000	976.411,58	0,33
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.25%/19-10.07.2025	3.600.000	3.425.400,00	1,17
CHF BARCLAYS PLC 1.125%/18-12.07.2023	7.000.000	6.982.500,00	2,39
EUR BARRY CALLEBAUT SERVICE 2.375%/16-240524	1.000.000	975.071,70	0,33
CHF BAWAG P.S.K. 2.87%/22-031025	2.000.000	2.020.000,00	0,69
CHF BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 0.45%/19-13.06.2023	3.890.000	3.818.813,00	1,30
CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	2.500.000	2.353.750,00	0,80
CHF BNP PARIBAS (SUBORDINATED) 1.75%/15-05.06.2025	4.000.000	3.924.000,00	1,34
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	3.000.000	2.743.500,00	0,94
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.1%/20-24.10.2023	3.000.000	2.970.600,00	1,01
CHF CBO FINANCE LTD 0.735%/20-27.11.2024	6.000.000	5.802.000,00	1,98
CHF CELLNEX FINANCE CO SA 0.935%/21-260326	2.000.000	1.890.000,00	0,65
CHF CEMBRA MONEY BANK AG 0.1525%/19-141026	2.000.000	1.831.000,00	0,63
CHF CENTRAL AMERICAN BANK 0.2%/19-25.03.2024	3.000.000	2.946.000,00	1,01
CHF CITIGROUP INC 0.5%/17-22.11.2024	5.000.000	4.847.500,00	1,66
CHF COMMERZBANK AG 1.1%/18-110725	2.000.000	1.927.000,00	0,66
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	4.000.000	4.096.000,00	1,40
CHF COOP-GRUPPE 0.75%/18-060625	2.000.000	1.935.000,00	0,66
CHF COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.75%/20-05.05.2023	2.000.000	1.998.200,00	0,68
CHF CREDIT AGRICOLE 1%/15-27.01.2025	1.000.000	977.500,00	0,33
CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 1%/19-07.11.2025	1.400.000	1.336.300,00	0,46
CHF CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.5%/20-01.10.2026	2.000.000	1.845.000,00	0,63
CHF CS GROUP FUNDING 1%/15-14.04.2023	3.000.000	2.983.500,00	1,02
CHF DAIMLER INTL FINANCE BV 0.85%/18-14.11.2025	500.000	486.250,00	0,17
CHF DEUTSCHE BANK AG 0.8%/20-070225	1.000.000	944.500,00	0,32
EUR DEUTSCHE BANK AG FF FRN/20-100626	2.000.000	1.863.359,20	0,64
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2.875%/17-28.06.2027	1.000.000	780.700,50	0,27
CHF DH SWITZERLAND FINANCE 0.5%/15-08.12.2023	3.000.000	2.973.000,00	1,02
CHF DIGITAL INTREPID 0.6%/22-021023	2.000.000	1.981.600,00	0,68
CHF DIGITAL INTREPID 1.7%/22-300327	2.000.000	1.886.000,00	0,64
CHF DNB BANK ASA 0.125%/18-301123	2.000.000	1.980.000,00	0,68
CHF DNB BANK ASA 1.1675%/22-030627	3.000.000	2.860.500,00	0,98
CHF E.ON SE 1.86%/22-051225	3.000.000	2.958.000,00	1,01
CHF EDF 0.3%/16-14.10.2024	2.000.000	1.938.000,00	0,66
EUR ERSTE GROUP BANK AG 0.875%/20-130527	2.000.000	1.744.219,50	0,60
CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.17%/17-18.07.2025	3.500.000	3.335.500,00	1,14
CHF FCA CAPITAL SUISSE SA 0.0519%/21-201224	1.000.000	955.000,00	0,33
CHF FCA CAPITAL SUISSE SA 0.1%/19-23.10.2023	2.230.000	2.202.794,00	0,75
CHF FED CAISSES DESJARDINS 1.735%/23-310128	3.000.000	2.959.500,00	1,01
CHF FIRMENICH INTERNATIONAL 1%/20-19.12.2023	2.000.000	1.983.000,00	0,68
CHF FIRST ABU DHABI BANK PJS 0.3225%/18-27.09.2023	1.000.000	992.000,00	0,34
CHF FIRST ABU DHABI BK P.J.S.C 0.401%/021024	2.000.000	1.938.000,00	0,66
EUR GLUTNIR 0%/16-08.01.2030	12.488	30,99	0,00
CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025	3.000.000	2.886.000,00	0,99
CHF GRANDE DIXENCE SA 1.25%/18-06.06.2023	4.000.000	3.994.400,00	1,36
CHF HEATHROW FUNDING 0.5%/16-170526	3.500.000	3.426.150,00	1,17
CHF HIRSLANDEN AG 1.25%/21-25.02.2026	2.660.000	2.540.300,00	0,87
CHF HSBC HOLDINGS PLC 1.805%/22-010626	1.000.000	971.000,00	0,33
USD HSBC HOLDINGS PLC FRN/21-240525	3.000.000	2.580.280,75	0,88
CHF HYPOTHEKAR BANK AG 0.45%/18-05.03.2024	3.000.000	2.944.500,00	1,01
EUR ING GROUP (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 17-26.09.2029	2.000.000	1.872.668,85	0,64
CHF INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0.25%/19-30.09.2024	2.600.000	2.515.240,00	0,86
EUR ISS GLOBAL 2.125%/14-02.12.2024	371.000	357.789,58	0,12
CHF JP MORGAN CHASE 0.5%/15-04.12.2023	3.000.000	2.967.000,00	1,01
CHF KEB HANA BANK 0.4075%/18-14.09.2023	2.000.000	1.983.000,00	0,68

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

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
CHF LLOYDS BANKING GROUP PLC 1%/18-04.03.2025	3.000.000	2.916.000,00	1,00	Andere Nettovermögenswerte		1.110.560,77	0,38
USD LIKUILO INTERNATIONAL FINANCE (REG. -S-) 4,563%/13-24.04.2023	1.000.000	804.331,98	0,27	Fondsvermögen		292.686.019,97	100,00
CHF MACQUARIE BANK 0,75%/16-05.02.2024	2.000.000	1.973.600,00	0,67				
CHF MBANK S.A. 1,0183%/19-04.10.24	2.000.000	1.859.000,00	0,64				
EUR MCDONALD'S (REG. -S-) S. 1 2,375%/12-27.11.2024	3.000.000	2.929.389,60	1,00				
CHF MCDONALD'S 0,17%/16-04.10.2024	1.500.000	1.458.000,00	0,50				
EUR MERCK REG S FF 14-121274	2.000.000	1.940.655,10	0,66				
CHF MONDELEZ INTERNATIONAL (REG. -S-) 1,125%/15-21.12.2023	2.000.000	1.988.000,00	0,68				
CHF MONDELEZ INTL REG S 0,617%/17-300924	2.000.000	1.960.000,00	0,67				
CHF MUJENCHENER HYPOTHEKENBNK 0,1%/20-17.12.2025	2.000.000	1.874.000,00	0,64				
CHF MUJENCHENER HYPOTHEKENBNK 0,3%/17-20.12.2024	2.500.000	2.408.750,00	0,82				
CHF NATI BUILDING SOCI 1,7575%/23-230126	2.000.000	1.981.000,00	0,68				
CHF NATWEST MARKETS PLC 0,8975%/22-040425	2.000.000	1.937.000,00	0,66				
EUR NATWEST MARKETS PLC 1%/19-28.05.2024	2.000.000	1.918.701,00	0,65				
CHF NORDEA BANK 0,55%/15-23.06.2025	3.000.000	2.889.000,00	0,99				
CHF NORDEA BANK ABP 1,81%/22-150627	1.000.000	970.500,00	0,33				
CHF ORANGE SA 0,2%/19-24.11.2025	2.000.000	1.909.000,00	0,65				
USD OTEL INTERNATIONAL (REG. -S-) 5%/10-19.10.2025	2.000.000	1.839.128,22	0,63				
CHF RAIFFEISENLANDESBANK OBERO 0,175%/291026	2.000.000	1.840.000,00	0,63				
CHF RCI BANQUE SA 0,5%/19-180724	1.000.000	972.500,00	0,33				
CHF RCI BANQUE SA 0,55%/18-30.05.2023	2.000.000	1.994.800,00	0,68				
CHF RCI BANQUE SA 2,1%/22-230525	1.000.000	981.500,00	0,34				
CHF ROCHE KAPITALMARKT 1,5%/22-230626	3.000.000	2.862.500,00	1,01				
CHF ROYAL BANK OF CANADA 0,1%/18-18.07.2023	2.000.000	1.990.200,00	0,68				
CHF ROYAL BANK OF CANADA 1,45%/22-040527	2.000.000	1.919.000,00	0,66				
CHF SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 0,15%/19-10.12.2024	2.300.000	2.213.750,00	0,76				
CHF SCOTIABANK CHILE 0,385%/21-220726	2.930.000	2.686.810,00	0,92				
CHF SGS 0,25%/15-08.05.2023	2.000.000	1.997.000,00	0,68				
CHF SOCIETE GENERALE 0,7%/18-260225	400.000	386.000,00	0,13				
CHF SOCIETE GENERALE 0,875%/19-28.02.2024	2.000.000	1.972.000,00	0,67				
CHF SOCIETE GENERALE SA 0,25%/19-08.10.2026	600.000	545.100,00	0,19				
CHF SOCIETE GENERALE SA 2,625%/22-141026	2.000.000	2.010.000,00	0,69				
CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 0,125%/19-11.12.2025	1.000.000	939.000,00	0,32				
CHF SULZER AG 1,3%/18-06.07.2023	1.000.000	997.600,00	0,34				
CHF SVENSKA HANDELSBANKEN 1,25%/22-240527	3.000.000	2.871.000,00	0,98				
CHF SWISS CREDIT CARD ISSUANCE 2020-1 LTD. 0,625%/20-15.06.2025	2.750.000	2.738.725,00	0,94				
CHF SYNGENTA FINANCE AG 1,25%/20-16.10.2023	3.000.000	2.979.000,00	1,02				
CHF TANNER SERVICIOS SA 1,15%/21-260424	3.000.000	2.878.800,00	0,98				
CHF TEMENOS AG 1,875%/18-301123	2.000.000	1.977.000,00	0,68				
CHF THE KOREA DEVELOPMENT BANK 0,445%/20-08.05.2025	3.000.000	2.878.500,00	0,98				
EUR TORONTO-DOMINION BANK 0,375%/19-25.04.2024	2.000.000	1.917.232,10	0,66				
CHF TORONTO-DOMINION BANK 2,2025%/23-310128	2.000.000	1.976.000,00	0,68				
CHF TRANSURBAN FINANCE 0,625%/16-23.06.2023	3.300.000	3.290.430,00	1,12				
CHF UBS GROUP FUNDING SWITZE 0,875%/300125	2.000.000	1.950.000,00	0,67				
CHF VERIZON COMMUNICATIONS 0,375%/17-31.05.2023	3.000.000	2.992.500,00	1,02				
CHF VERIZON COMMUNICATIONS 1%/17-301127	1.000.000	938.500,00	0,32				
CHF VODAFONE GROUP 0,625%/17-150327	3.000.000	2.832.000,00	0,97				
Total Anleihen		265.217.021,65	90,61				
Hypotheken, Asset-Back-Securities							
CHF FIRST SWISS MOBILITY S. -2020-2 A- 0,625%/20-22.11.2029	3.000.000	2.957.550,00	1,01				
CHF SWISS CAR AG S 2021-1 A 0,5%/21-180431	2.280.000	2.229.156,00	0,76				
Total Hypotheken, Asset-Back-Securities		5.186.706,00	1,77				
Zertifikate							
EUR GLITNIR HOLDCO EHF HLTASKÁ Á-RTEINI AHLUTIR SHARE CERTIFICATE ASHARES	77.548	0,08	0,00				
Total Zertifikate		0,08	0,00				
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		270.403.727,73	92,39				
Nicht börsennotierte Wertpapiere							
Anleihen							
CHF BAWAG AG 2,0525%/23-140428	2.000.000	1.993.940,00	0,68				
Total Anleihen		1.993.940,00	0,68				
Nicht börsennotierte Wertpapiere		1.993.940,00	0,68				
Investmentfonds							
Fondsanteile (Open-End)							
CHF CS INSTIT MASTER FD - MONEY MKT CHF EB	1.000	892.070,00	0,30				
Total Fondsanteile (Open-End)		892.070,00	0,30				
Total Investmentfonds		892.070,00	0,30				
Total des Wertpapierbestandes		273.289.737,73	93,37				
Bareinlagen bei Banken und Brokern		18.285.721,47	6,25				

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

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	1498949	LU0155953028	0,60%	0,84%
B - Thesaurierend	USD	1498955	LU0155953705	0,60%	0,84%
DA - Ausschüttend	USD	52329864	LU2039696278	0,00%	0,12%
DB - Thesaurierend	USD	1571294	LU0164804360	0,00%	0,12%
EA - Ausschüttend	USD	23529720	LU1024301316	0,25%	0,45%
EB - Thesaurierend	USD	11660401	LU0535913965	0,25%	0,45%
IB - Thesaurierend	USD	1498957	LU0155953960	0,30%	0,53%
UA - Ausschüttend	USD	26364768	LU1144399836	0,45%	0,69%
UB - Thesaurierend	USD	26367338	LU1144399919	0,45%	0,68%

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

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	1,19%	/	-4,27%	-0,44%	3,59%
B - Thesaurierend	USD	1,20%	/	-4,27%	-0,43%	3,59%
DA - Ausschüttend	USD	1,39%	1,47%	-3,59%	0,27%	/
DB - Thesaurierend	USD	1,39%	/	-3,59%	0,27%	4,30%
EA - Ausschüttend	USD	1,30%	/	-3,90%	-0,05%	4,00%
EB - Thesaurierend	USD	1,30%	/	-3,90%	-0,05%	4,00%
IB - Thesaurierend	USD	1,27%	/	-3,98%	-0,14%	3,90%
UA - Ausschüttend	USD	1,24%	/	-4,13%	-0,29%	3,75%
UB - Thesaurierend	USD	1,24%	/	-4,12%	-0,29%	3,75%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
A - Ausschüttend	USD	17.05.2022	1,56
DA - Ausschüttend	USD	17.05.2022	25,34
EA - Ausschüttend	USD	17.05.2022	22,00
UA - Ausschüttend	USD	17.05.2022	1,92

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In USD)
EUR	150.000	USD	-159.082	28.04.2023	4.146,30
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.020.000	USD	-1.098.793	28.04.2023	11.156,76
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	3.200.000	USD	-3.393.699	28.04.2023	88.496,00
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.532.112	EUR	-1.400.000	28.04.2023	8.638,20
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	30.625.980	EUR	-28.000.000	28.04.2023	156.521,90
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften**268.959,16**

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

		31.03.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		381.261.607,65			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		84.308,62			
Forderungen aus Erträgen		2.893.408,01			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		268.959,16			
		384.508.283,44			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		1.046.264,01			
		128.791,90			
		1.175.055,91			
Nettovermögen		383.333.227,53			
Fondsentwicklung		31.03.2023	31.03.2022	31.03.2021	
Fondsvermögen	USD	383.333.227,53	456.333.660,44	540.112.106,97	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	USD	81,65	83,25	87,91	
B - Thesaurierend	USD	148,85	148,90	153,88	
DA - Ausschüttend	USD	956,07	975,02	1.029,42	
DB - Thesaurierend	USD	1.157,48	1.149,47	1.179,61	
EA - Ausschüttend	USD	948,10	966,93	1.021,12	
EB - Thesaurierend	USD	1.159,90	1.155,77	1.189,82	
IB - Thesaurierend	USD	1.099,40	1.096,44	1.129,74	
UA - Ausschüttend	USD	92,41	94,24	99,51	
UB - Thesaurierend	USD	110,61	110,48	114,01	
Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	USD	157.793,820	185.643,955	12.567,184	40.417,319
B - Thesaurierend	USD	311.520,005	432.053,131	40.830,138	161.363,264
DA - Ausschüttend	USD	9.311,616	7.465,972	2.209,242	363,598
DB - Thesaurierend	USD	161.120,549	151.077,999	48.244,336	38.201,786
EA - Ausschüttend	USD	19.129,552	22.146,093	18.529,050	21.545,591
EB - Thesaurierend	USD	52.884,087	84.353,588	21.859,109	53.328,610
IB - Thesaurierend	USD	26.096,311	35.878,879	458,118	10.240,686
UA - Ausschüttend	USD	50.583,768	61.698,886	2.608,269	13.723,387
UB - Thesaurierend	USD	143.209,905	285.549,733	40.304,991	182.644,819

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

	Für die Periode vom 01.04.2022 bis zum 31.03.2023
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	456.333.660,44
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	11.733.735,33
Bankzinsen	67.376,90
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	75.757,66
	11.876.869,89
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.007.324,48
Depotbank- und Depotgebühr	241.869,98
Zentralverwaltungsvergütung	157.503,50
Druck- und Veröffentlichungskosten	20.262,88
Zinsen und Bankspesen	8.154,11
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	127.376,97
"Taxe d'abonnement"	72.192,43
	1.634.684,35
Nettoerträge (-verluste)	10.242.185,54
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-18.929.940,02
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	-248.629,53
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	4.274.465,68
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	5.876.313,10
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-64.927,32
	-9.092.718,09
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	1.149.467,45
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	4.059.181,71
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-3.059.477,15
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-1.788.423,57
	-788.719,01
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	360.748,44
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	111.768.012,99
Rücknahmen	-184.027.946,81
	-72.259.933,82
Ausschüttung	-1.101.247,53
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	383.333.227,53

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	57,49
Grossbritannien	9,00
Niederlande	5,29
Frankreich	3,50
Japan	2,94
Kanada	2,51
Deutschland	2,11
Irland	2,01
Supranational	1,98
Kaimaninseln	1,91
Schweiz	1,78
Dänemark	1,29
Schweden	1,01
Mexiko	0,98
Spanien	0,95
Peru	0,90
Österreich	0,81
Vereinigte Arabische Emirate	0,75
Belgien	0,70
Bermudas	0,52
Italien	0,52
Ägypten	0,51
Total	99,46

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	35,24
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	24,05
Länder und Zentralregierungen	9,53
Computerhardware und Netzwerk	3,96
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	3,93
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	2,69
Supranationale Organisationen	2,49
Gesundheits- und Sozialdienste	2,46
Einzelhandel und Warenhäuser	2,41
Petroleum	2,15
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,88
Telekommunikation	1,86
Biotechnologie	1,26
Energie- und Wasserversorgung	1,23
Versicherungsgesellschaften	0,85
Grafikverlags- und Druckmedien	0,74
Chemie	0,53
Elektrische Geräte und Komponenten	0,52
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,51
Immobilien	0,48
Verschiedene Konsumgüter	0,39
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,31
Total	99,46

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
USD 7-ELEVEN INC 0.95%/21-10.02.2026	4.000.000	3.597.600,00	0,94
USD ABBVIE 3.6%/15-14.05.2025	2.500.000	2.452.850,00	0,64
USD ABBVIE INC 2.6%/20-21.11.2024	3.000.000	2.895.480,00	0,76
USD ABN AMRO BANK REG S 4.75%/15-280725	3.000.000	2.909.715,00	0,76
USD AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.75%/21-291024	5.000.000	4.666.550,00	1,22
USD AFRICA FINANCE CORP 3.125%/20-16.06.2025	5.000.000	4.630.750,00	1,21
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BA 4.125%/17-20.05.2024	2.000.000	1.946.940,00	0,51
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BA 5.25%/18-11-10.2023	3.000.000	2.974.740,00	0,78
EUR ALLIANZ SE FIX-TO-FRN (SUBORDINATED) 6.25%13-PERPETUAL	3.000.000	3.256.709,93	0,85
USD ALLY FINANCIAL INC 1.45%/20-02.10.2023	350.000	339.843,00	0,09
USD ALLY FINANCIAL INC 3.875%/19-210524	1.000.000	958.550,00	0,25
USD ALLY FINANCIAL INC 5.8%/20-010525	750.000	725.197,50	0,19
USD AMAZON.COM INC 4.6%/22-011225	2.000.000	2.017.700,00	0,53
USD AMAZON.COM INC 4.7%/22-291124	2.000.000	2.014.680,00	0,53
USD AMERICAN TOWER CORP 1.3%/20-15.09.2025	2.000.000	1.837.020,00	0,48
USD AMGEN INC 1.9%/20-21.02.2025	3.000.000	2.856.000,00	0,75
USD AMGEN INC 5.25%/23-020325	1.000.000	1.011.340,00	0,26
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL 3.625%/17-110924	3.000.000	2.928.750,00	0,76
USD ANTHEM INC 2.375%/19-15.01.2025	2.000.000	1.915.760,00	0,50
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 1.2%/21-280526	3.000.000	2.732.640,00	0,71
USD BANCO DE CREDITO DEL PER 2.7%/19-11.01.2025	1.500.000	1.434.795,00	0,37
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU CREDITO (REG. - S-) 4.25%/13-01.04.2023	2.000.000	2.000.000,00	0,52
USD BANCO SANTANDER SA 3.496%/22-240325	1.600.000	1.538.496,00	0,40
USD BANCO SANTANDER SA S114 FF FRN/21-140927	2.400.000	2.094.576,00	0,55
USD BANK OF AMERICA CORP FF FRN/20-241024	4.000.000	3.889.280,00	1,01
USD BANK OF AMERICA CORP FF FRN/22-220726	4.500.000	4.447.880,00	1,16
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025	4.500.000	4.287.600,00	1,12
USD BANK OF IRELAND GROUP 4.5%/18-25.11.2023	2.100.000	2.080.218,00	0,54
USD BANK OF MONTREAL S F 1.5%/22-100125	2.000.000	1.881.400,00	0,49
USD BANK OF NOVA SCOTIA 0.7%/21-150424	2.500.000	2.390.125,00	0,62
USD BARCLAYS 3.65%/15-16.03.2025	3.000.000	2.871.630,00	0,75
USD BARCLAYS PLC FF FRN/20-101224	2.000.000	1.929.780,00	0,50
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 1.322%/22-291124	2.000.000	1.882.620,00	0,49
EUR BERRY GLOBAL INC 1%/20-15.01.2025	500.000	516.449,44	0,13
USD BNP PARIBAS 3.375%/18-090125	2.000.000	1.920.900,00	0,50
USD BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	2.000.000	1.917.620,00	0,50
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.9%/20-26.07.2024	2.856.000	2.802.278,64	0,73
USD BROADCOM INC 3.15%/20-15.11.2025	4.000.000	3.841.320,00	1,00
USD CAPITAL ONE FINANCIAL 3.2%/15-050225	3.000.000	2.829.690,00	0,74
USD CATERPILLAR FINL SERVICE 3.4%/22-130525	3.000.000	2.940.120,00	0,77
USD CBO FINANCE LTD 5%/18-24.05.2023	2.000.000	1.997.740,00	0,52
USD CELANESE US 6.05%/22-150325	2.000.000	2.013.400,00	0,53
USD CHARTER COM OP 4.908%/16-230725	2.000.000	1.979.700,00	0,52
USD CITIGROUP INC FF FRN/22-240525	2.900.000	2.854.325,00	0,74
USD CITIGROUP INC FF FRN/22-290926	3.000.000	3.018.300,00	0,79
USD CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-08.04.2026	2.000.000	1.913.620,00	0,50
USD CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-30.10.2024	3.000.000	2.916.570,00	0,76
USD COMCAST CORP 3.7%/18-150424	1.000.000	988.800,00	0,26
USD COMCAST CORP 6.25%/22-071125	400.000	409.316,00	0,11
USD CREDIT AGRICOLE LONDON FF FRN/20-160626	3.000.000	2.760.120,00	0,72
USD CVS HEALTH CORP 2.625%/19-150624	3.000.000	2.914.770,00	0,76
USD CVS HEALTH CORP 5%/23-200226	500.000	505.980,00	0,13
USD DANSKE BANK A/S 1.226%/20-220624	3.000.000	2.959.290,00	0,77
USD DANSKE BANK A/S 3.875%/18-12.09.2023	2.000.000	1.987.800,00	0,52
USD DELL INT LLC / EMC CORP 5.25%/23-010228	1.350.000	1.364.364,00	0,36
USD DELL INT LLC / EMC CORP 5.45%/21-150623	1.695.000	1.695.237,30	0,44
EUR DEUTSCHE BAHN FIN GMBH SUB FF FRN/19-PER	1.500.000	1.514.065,86	0,39
USD DEUTSCHE BANK NY S D FF FRN/19-261125	3.500.000	3.312.715,00	0,86
USD EDP FINANCE BV 3.625%/17-150724	2.500.000	2.446.950,00	0,64
USD ELEVANCE HEALTH INC 4.9%/23-080226	450.000	448.960,50	0,12
USD ENABLE MIDSTREAM PARTNER 3.9%/15-15.05.2024	2.000.000	1.961.660,00	0,51
USD ENBRIDGE INC 1.6%/21-041026	1.500.000	1.346.985,00	0,35
USD ENEL FINANCE N.V. 4.25%/22-150625	1.450.000	1.420.985,50	0,37
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS 4.2%/18-150923	3.000.000	2.985.630,00	0,78
EUR ENI SPA SUB FF FRN/20-PERPET	2.000.000	2.007.650,96	0,52
USD EUROCLEAR BANK SA 1.261%/21-030626	3.000.000	2.679.270,00	0,70
EUR FIRST ABU DHABI BANK PUS 0.125%/21-16.02.2026	2.950.000	2.878.948,00	0,75
USD GE CAPITAL FUNDING 3.45%/21-150525	2.000.000	1.947.580,00	0,51
USD GE HEALTHCARE HLDG LLC 5.55%/22-151124	2.000.000	2.013.160,00	0,53
USD GE HEALTHCARE HLDG LLC 5.55%/22-151124	600.000	603.948,00	0,16
USD GENERAL MOTORS FINL CO 1.25%/21-080126	2.000.000	1.802.400,00	0,47
USD GILEAD SCIENCES 3.7%/14-010424	2.000.000	1.976.620,00	0,52
USD GLENCORE FUNDING LLC 4.125%/19-12.03.2024	1.200.000	1.187.424,00	0,31
USD GOLDMAN SACHS GROUP 4%/14-03.03.2024	1.000.000	985.340,00	0,26
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5%/20-01.04.2025	6.000.000	5.829.060,00	1,52
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC FF FRN/21-120226	3.000.000	2.746.290,00	0,72
EUR GRENKE FINANCE PLC 0.625%/19-090125	1.000.000	972.568,31	0,25

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

Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD GSK CONSUMER 3.125%/22-240325	650.000	628.563,00	0,16
USD HCA 5.375%/15-010225	2.500.000	2.501.275,00	0,65
USD HP ENTERPRISE CO 1.75%/20-01.04.2026	4.000.000	3.683.320,00	0,96
USD HP INC 2.2%/20-17.06.2025	2.750.000	2.595.752,50	0,68
USD HSBC HOLDINGS PLC FIX-TO-FRN FRN/20-18.04.2026	2.500.000	2.286.100,00	0,60
USD HSBC HOLDINGS PLC FRN/21-240525	3.000.000	2.826.840,00	0,74
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA 1.8%/20-15.10.2025	2.000.000	1.838.140,00	0,48
USD IBM CORP 4%/22-270725	3.150.000	3.115.318,50	0,81
USD ING GROUP NV 3.55%/19-09.04.2024	2.600.000	2.551.874,00	0,67
USD JOHN DEERE CAPITAL 3.4%/22-280325	4.000.000	3.870.840,00	1,01
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP S G 2.05%/090125	1.850.000	1.813.240,50	0,47
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/20-130326	2.000.000	1.929.120,00	0,50
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-040227	6.000.000	5.657.940,00	1,48
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-090825	1.000.000	892.860,00	0,23
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-160225	2.500.000	2.350.075,00	0,61
USD JPMORGAN CHASE & CO FF FRN/21-160225	4.500.000	4.318.965,00	1,13
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC FIX-TO-FRN FRN/20-07.07.2025	5.000.000	4.862.600,00	1,27
USD MAGALLANES INC 3.428%/22-150324	2.500.000	2.444.350,00	0,64
USD MAGALLANES INC 3.528%/22-150324	1.425.000	1.393.450,50	0,36
USD MATTEL INC 5.875%/19-15.12.2027	1.500.000	1.493.835,00	0,39
USD MET LIFE GLOB I 2.8%/22-210325	2.500.000	2.415.100,00	0,63
USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.193%/20-250225	2.500.000	2.356.025,00	0,61
USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.801%/180724	2.000.000	1.930.560,00	0,50
USD MITSUBISHI UFJ FRN/22-120925	1.800.000	1.787.886,00	0,47
USD MORGAN STANLEY S F 3.7%/14-23.10.24	2.000.000	1.963.940,00	0,51
USD MORGAN STANLEY S F 4%/15-230725	5.500.000	5.400.780,00	1,41
USD MORGAN STANLEY S I FF FRN/22-170726	3.500.000	3.461.710,00	0,90
USD NATIONAL SECS CLEARING 1.5%/20-230425	2.500.000	2.330.875,00	0,61
USD NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0.55%/21-22.01.2024	800.000	768.624,00	0,20
EUR NATWEST MARKETS PLC 0.125%/21-121.12.25	3.000.000	2.957.143,07	0,77
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.648%/20-160125	1.200.000	1.137.324,00	0,30
USD NXP BV/NXP FDG/NXP USA 2.7%/22-010525	3.000.000	2.847.660,00	0,74
EUR OMY AG SUB FF FRN/18-PERPET	2.000.000	2.107.756,46	0,55
USD ORACLE 3.4%/14-080724	3.000.000	2.940.120,00	0,77
USD ORACLE CORP 1.65%/21-250326	1.500.000	1.378.410,00	0,36
EUR ORANGE FF 5.25%/14-PERPET	1.500.000	1.630.717,99	0,43
USD PEPSICO INC 2.25%/20-19.03.2025	3.000.000	2.896.230,00	0,76
USD PRINCIPAL LIFE GLB FND II 1.25%/20-23.06.2025	2.000.000	1.827.160,00	0,48
USD PROSUS N.V. 3.257%/22-190127	1.000.000	912.120,00	0,24
EUR PROSUS NV 1.207%/22-190126	700.000	681.999,43	0,18
USD QNB FINANCE LTD 1.625%/20-22.09.2025	4.300.000	3.971.265,00	1,04
USD QNB FINANCE LTD 3.5%/19-28.03.2024	2.000.000	1.968.300,00	0,51
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE FIX-TO-FRN (REG. -S-) (SUBORDINATED) 15-25.03.2075	1.500.000	1.586.407,13	0,41
USD ROYAL BANK OF CANADA 4.875%/23-120126	4.000.000	4.008.720,00	1,05
USD ROYAL BANK SCOTLAND 3.875%/16-120923	2.500.000	2.471.650,00	0,64
USD SAUDI ELEC GLB SUKUK 1.74%/20-17.09.2025	1.500.000	1.396.365,00	0,36
EUR SIGMA ALIMENT REG S 2.625%/17-070224	3.500.000	3.748.464,36	0,98
USD SOCIETE GENERALE SA 1.488%/20-14.12.2026	3.000.000	2.623.110,00	0,68
USD SOCIETE GENERALE SA FF FRN/22-210126	2.500.000	2.308.125,00	0,60
USD STANDARD CHARTERED FF FRN/21-120125	2.500.000	2.396.175,00	0,63
USD SUMITOMO MITSUI FINL GRP 0.948%/21-12.01.2026	4.550.000	4.049.136,00	1,06
USD SUZANO AUSTRIA (REG. -S-) 5.75%/16-14.07.2026	1.000.000	1.004.080,00	0,26
USD SWEDBANK AB 3.356%/22-040425	4.000.000	3.868.720,00	1,01
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.375%/19-19.03.2024	2.500.000	2.404.325,00	0,63
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.875%/22-130625	1.200.000	1.112.976,00	0,29
USD T-MOBILE USA INC 2.25%/21-150226	2.000.000	1.866.660,00	0,49
EUR TOTAL (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2.708%/16-PERPETUAL	2.000.000	2.170.270,79	0,57
USD UBS GROUP AG FF FRN/22-120526	4.000.000	3.860.960,00	1,01
USD UBS GROUP AG FIX-TO-FRN FRN/20-30.07.2024	3.000.000	2.949.720,00	0,77
EUR UPJOHN FINANCE BV 1.023%/20-23.06.2024	1.000.000	1.048.435,11	0,27
USD US TREASURY N/B 2.625%/22-150425	4.000.000	3.888.281,24	1,01
USD US TREASURY N/B 2.75%/22-150525	5.000.000	4.870.507,80	1,27
USD US TREASURY N/B 3.5%/23-310128	7.000.000	6.965.000,00	1,82
USD US TREASURY N/B 3.875%/23-311227	8.000.000	8.085.937,52	2,11
USD US TREASURY N/B 4%/22-151225	3.000.000	3.011.835,93	0,79
USD US TREASURY N/B S AK-2025 1.5%/22-150225	3.000.000	2.858.613,27	0,75
USD VERIZON COMMUNICATIONS 0.75%/21-220324	1.200.000	1.151.388,00	0,30
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.5%/14-01.11.2024	500.000	491.085,00	0,13
USD VMWARE INC 4.5%/20-15.05.2025	2.000.000	1.977.420,00	0,52
USD VODAFONE GROUP 4.125%/18-300525	2.000.000	1.976.920,00	0,52
USD WALMART INC 3.9%/22-090925	1.600.000	1.597.504,00	0,42
USD WALT DISNEY COMPANY/THE 1.75%/19-300824	1.500.000	1.443.975,00	0,38
USD WELLPOINT 3.5%/14-15.08.2024	2.000.000	1.959.580,00	0,51
USD WELLS FARGO & COM FRN/22-250426	5.000.000	4.849.700,00	1,27
USD WESTERN DIGITAL CORP 4.75%/18-15.02.2026	2.000.000	1.929.440,00	0,50
USD WILLIAMS COMPANIES 4.55%/14-240624	2.000.000	1.986.680,00	0,52
Total Anleihen		370.157.479,04	96,56
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		370.157.479,04	96,56
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
USD COCA-COLA EUROPEAN PLC 0.8%/21-030524	3.850.000	3.669.781,50	0,96
USD VIATRIS INC 1.65%/21-220625	650.000	597.538,50	0,16
Total Anleihen		4.267.320,00	1,11

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Nicht börsennotierte Wertpapiere		4.267.320,00	1,11
Geldmarktinstrumente			
USD TREASURY BILL 0%/23-280923	7.000.000	6.836.808,61	1,78
Total Geldmarktinstrumente		6.836.808,61	1,78
Total des Wertpapierbestandes		381.261.607,65	99,46
Bareinlagen bei Banken und Brokern		84.308,62	0,02
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-1.046.264,01	-0,27
Andere Nettovermögenswerte		3.033.575,27	0,79
Fondsvermögen		383.333.227,53	100,00

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

Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	CHF	1664162	LU0175163707	0,75%	1,01%
B - Thesaurierend	CHF	1664165	LU0175163889	0,75%	1,01%
EB - Thesaurierend	CHF	22716069	LU0987306726	0,30%	0,53%
IB - Thesaurierend	CHF	1664170	LU0175164002	0,38%	0,63%
UA - Ausschüttend	CHF	26377043	LU1144400600	0,45%	0,71%
UB - Thesaurierend	CHF	26377052	LU1144400782	0,45%	0,71%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	CHF	-0,21%	/	-0,19%	3,93%	-1,68%
B - Thesaurierend	CHF	-0,20%	/	-0,20%	3,94%	-1,68%
EB - Thesaurierend	CHF	-0,08%	/	0,29%	4,44%	-1,20%
IB - Thesaurierend	CHF	-0,11%	/	0,17%	4,32%	-1,31%
UA - Ausschüttend	CHF	-0,12%	/	0,10%	4,25%	-1,39%
UB - Thesaurierend	CHF	-0,13%	/	0,10%	4,25%	-1,39%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In CHF)
EUR	200.000	CHF	-196.779	28.04.2023	1.440,40
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	183.621	USD	-200.000	28.04.2023	1.470,32
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	200.000	CHF	-184.332	28.04.2023	-2.176,30
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	295.130	EUR	-300.000	28.04.2023	-2.201,51
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	270.000	CHF	-265.541	28.04.2023	2.054,43
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	167.891	EUR	-170.000	28.04.2023	-595,67
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-8,33

Swapkontrakte

Art		Verbindlichkeiten		Forderungen	Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert			(in EUR)
IRS	EUR	1.000.0002.4552	EUR	1.000.000Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15.01.2025	5.669,16
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>						
IRS	USD	5.000.0003.1342	USD	5.000.000Zero Coupon/US Inflation - Interpolated - Maturity	04.11.2025	175.058,93
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>						
IRS	EUR	10.000.0002.9652	EUR	10.000.000Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15.12.2025	13.813,62
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>						
IRS	EUR	6.000.0002.3632	EUR	6.000.000Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15.01.2026	41.534,14
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>						

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Art	Verbindlichkeiten		Forderungen		Fälligkeit	Bewertung	
<i>Gegenpartei</i>	Nennwert		Nennwert			(in EUR)	
IRS EUR	4.000.000	2.6781	EUR	4.000.000	Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15.02.2026	-14.430,95
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	5.000.000	3.0712	USD	5.000.000	Zero Coupon/US Inflation - Interpolated - Maturity	09.11.2026	162.097,83
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	6.500.000	3.3352	USD	6.500.000	Zero Coupon/US Inflation - Interpolated - Maturity	07.03.2027	17.197,12
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	3.500.000	2.6357	USD	3.500.000	Zero Coupon/US Inflation - Interpolated - Maturity	29.11.2027	7.592,31
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	7.500.000	2.6252	EUR	7.500.000	Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15.12.2027	42.835,31
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	3.500.000	2.3892	EUR	3.500.000	Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15.01.2028	18.400,95
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS USD	1.500.000	2.3702	USD	1.500.000	Zero Coupon/US Inflation - Interpolated - Maturity	18.01.2028	16.148,39
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
IRS EUR	2.750.000	2.8802	EUR	2.750.000	Zero Coupon/EUR Inflation - Maturity	15.03.2028	-35.785,58
<i>JP Morgan Securities PLC - London - Vereinigtes Königreich</i>							
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten							450.131,23

Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

		31.03.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		63.594.450,00			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.775.042,12			
Forderungen aus Erträgen		240.330,83			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Swapkontrakten		450.131,23			
		67.059.954,18			
Passiva					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		254.653,77			
Rückstellungen für Aufwendungen		56.347,32			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		8,33			
		311.009,42			
Nettovermögen		66.748.944,76			
Fondsentwicklung					
		31.03.2023	31.03.2022	31.03.2021	
Fondsvermögen	CHF	66.748.944,76	100.766.437,73	87.622.388,61	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	CHF	92,49	94,49	90,56	
B - Thesaurierend	CHF	112,03	114,45	109,69	
EB - Thesaurierend	CHF	1.032,78	1.049,91	1.001,35	
IB - Thesaurierend	CHF	1.022,48	1.040,62	993,63	
UA - Ausschüttend	CHF	98,07	99,88	95,57	
UB - Thesaurierend	CHF	101,59	103,48	98,88	
Anzahl der Anteile im Umlauf					
		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	CHF	145.317,210	173.552,887	15.949,774	44.185,451
B - Thesaurierend	CHF	267.413,803	357.593,335	59.063,642	149.243,174
EB - Thesaurierend	CHF	2.741,107	7.919,537	872,765	6.051,195
IB - Thesaurierend	CHF	3.133,664	8.414,664	478,000	5.759,000
UA - Ausschüttend	CHF	55.995,326	94.926,827	16.337,528	55.269,029
UB - Thesaurierend	CHF	116.374,679	163.224,423	33.097,257	79.947,001

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in CHF)Für die Periode vom
01.04.2022 bis zum
31.03.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	100.766.437,73
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	738.391,36
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	6.636,73
	745.028,09
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	542.046,30
Depotbank- und Depotgebühr	50.557,51
Zentralverwaltungsvergütung	61.821,24
Druck- und Veröffentlichungskosten	11.898,92
Zinsen und Bankspesen	28.603,79
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	100.769,47
"Taxe d'abonnement"	38.727,58
	834.424,81
Nettoerträge (-verluste)	-89.396,72
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.674.091,15
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	8.129.754,59
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	50.090,88
	4.505.754,32
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	4.416.357,60
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	104.501,00
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-6.373.076,25
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-8,33
	-6.268.583,58
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-1.852.225,98
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	14.702.705,87
Rücknahmen	-46.867.972,86
	-32.165.266,99
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	66.748.944,76

Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	19,57
Frankreich	18,25
Kanada	8,63
Grossbritannien	7,34
Niederlande	5,48
Chile	4,67
Australien	3,51
Deutschland	3,50
Südkorea	3,29
Neuseeland	3,04
Supranational	2,82
Finnland	2,54
Österreich	2,36
Luxemburg	2,24
Schweden	2,16
Vereinigte Arabische Emirate	1,79
Irland	1,45
Schweiz	1,33
Spanien	1,31
Total	95,27

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	66,45
Supranationale Organisationen	5,75
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	5,02
Telekommunikation	3,98
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	3,39
Kantone, Bundesländer, Provinzen	2,72
Computerhardware und Netzwerk	1,76
Verkehr und Transport	1,50
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	1,46
Städte und Gemeinden	1,04
Energie- und Wasserversorgung	1,02
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,76
Petroleum	0,44
Total	95,27

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
CHF ANZ NEW ZEALAND (INTL) LTD 0.25%/220925	800.000	760.800,00	1,14
CHF APPLE 0.375%/15-25.11.2024	1.200.000	1.172.400,00	1,76
CHF ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025	600.000	576.900,00	0,86
CHF AUCKLAND COUNCIL 1.5%/14-281125	700.000	693.350,00	1,04
CHF BANCO BICE 0.75%/21-291026	1.000.000	875.000,00	1,31
CHF BANCO DE CHILE 0.3154%/21-040127	310.000	278.380,00	0,42
CHF BANCO SANTANDER 0.2975%/21-221026	455.000	410.637,50	0,62
CHF BANCO SANTANDER CHILE 0.33%/21-220627	360.000	319.140,00	0,48
CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	1.000.000	877.000,00	1,31
CHF BANK OF AMERICA CORP 0.2525%/19-12.06.2026	1.300.000	1.222.650,00	1,83
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.278%/22-010427	600.000	558.600,00	0,84
CHF BANQUE FEDERATIVE S 525 1.5%/22-010627	1.000.000	954.500,00	1,43
CHF BARCLAYS PLC 0.315%/21-040627	1.000.000	906.500,00	1,36
CHF BEL 1.625%/12-02.04.2025	1.500.000	1.494.750,00	2,24
CHF BNG 2.5%/05-21.07.2025	1.165.000	1.183.057,50	1,77
CHF BNP PARIBAS SA 0.3%/19-15.10.2027	1.000.000	893.000,00	1,34
CHF BNP PARIBAS SA 0.5275%/22-200128	1.000.000	899.000,00	1,35
CHF CADES 2.5%/11-091225	500.000	507.000,00	0,76
CHF CAISSE DES DEPOTS ET CON 0.3%/17-12.11.2027	600.000	554.700,00	0,83
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK 0.2825%/22-030227	1.200.000	1.103.400,00	1,65
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	1.200.000	1.097.400,00	1,64
CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028	1.000.000	894.500,00	1,34
CHF CITIGROUP INC 0.75%/19-02.04.2026	1.050.000	993.825,00	1,49
CHF COCA-COLA (REG. -S-) 1%/15-02.10.2028	1.000.000	948.000,00	1,42
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	1.000.000	936.000,00	1,40
CHF COOPERATIVE RABOBANK 1.3625%/22-280428	600.000	566.400,00	0,85
CHF COOPERATIVE RABOBANK UA 0.25%/19-25.11.2027	1.000.000	888.500,00	1,33
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	535.000	547.840,00	0,82
CHF CORP ANDINA DE FOMENTO 0.7%/20-04.09.2025	1.000.000	962.000,00	1,44
CHF CORPORACION ANDINA 0.45%/22-240227	1.000.000	922.500,00	1,38
CHF CREDIT AGRICOLE 1%/15-27.01.2025	1.000.000	977.500,00	1,46
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.1%/16-26.01.2026	500.000	473.000,00	0,71
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.5%/15-16.03.2027	1.000.000	940.000,00	1,41
CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 0.55%/16-141226	500.000	465.000,00	0,70
CHF CREDIT AGRICOLE SA 1.4604%/22-010727	500.000	482.000,00	0,72
CHF EDF 0.3%/16-14.10.2024	700.000	678.300,00	1,02
CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.17%/17-18.07.2025	1.300.000	1.238.900,00	1,86
CHF FIRST ABU DHABI BANK 0.1475%/21-171126	500.000	459.750,00	0,69
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	500.000	451.000,00	0,68
CHF FIRST ABU DHABI BK PJS 0.205%/19-041225	300.000	281.850,00	0,42
CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.4%/21-110528	1.000.000	897.500,00	1,34
CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025	500.000	481.000,00	0,72
CHF HSBC HOLDINGS PLC 0.32%/21-031127	1.000.000	899.000,00	1,35
CHF HSBC HOLDINGS PLC 1.805%/22-010626	400.000	388.400,00	0,58
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.45%/18-05.03.2024	1.000.000	961.500,00	1,47
CHF INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0.25%/19-30.09.2024	1.000.000	967.400,00	1,45
CHF JP MORGAN CHASE REG. S 0.45%/111126	1.000.000	936.000,00	1,40
CHF KFW 2.5%/05-25.08.2025	500.000	509.250,00	0,76
CHF LAND NIEDEROESTERREICH 0.04%/16-231026	320.000	298.720,00	0,45
CHF MCDONALD'S 0.17%/16-04.10.2024	1.000.000	972.000,00	1,46
CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027	1.000.000	914.000,00	1,37
CHF MONDELEZ INTERNATIONAL 1.125%/15-30.12.2025	400.000	388.000,00	0,58
CHF MUENCHENER EG 0.4%/22-250226	600.000	563.400,00	0,84
CHF MUENCHENER HYPO EG 0.01%/21-101126	400.000	371.600,00	0,56
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBK 0.125%/19-181127	1.000.000	891.500,00	1,34
CHF MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/11-300326	530.000	537.420,00	0,81
CHF NAT BANK OF CANADA 1.9575%/22-031127	500.000	497.000,00	0,74
CHF NATI BUILDING SOCI 1.7575%/23-230126	500.000	495.250,00	0,74
CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.3%/17-31.10.2025	500.000	475.000,00	0,71
CHF NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0%/19-11.07.2025	700.000	668.150,00	1,00
CHF NATWEST MARKETS 2.7825%/22-061227	600.000	596.700,00	0,89
CHF NEDER WATERSCHAPS BANK 0.235%/22-140427	500.000	469.000,00	0,70
CHF NESTLE HOLDINGS INC 0.25%/17-041027	1.000.000	925.500,00	1,39
CHF NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.25%/19-18.10.2027	1.000.000	910.000,00	1,36
CHF NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025	1.200.000	1.155.600,00	1,73
CHF NORTH AMERICAN DEV BK 0.2%/17-261027	500.000	458.750,00	0,69
CHF ORANGE SA 0.2%/19-24.11.2025	1.300.000	1.240.850,00	1,86
CHF QUEBEC 0.75%/14-21.11.2024	1.000.000	981.000,00	1,47
CHF RAIFFEISENLANDESBANK OBERO 0.175%/291026	320.000	294.400,00	0,44
CHF ROYAL BANK CANADA 0.4%/22-051027	600.000	565.800,00	0,85
CHF ROYAL BANK OF CANADA 1.45%/22-040527	1.000.000	959.500,00	1,44
CHF SCOTIABANK CHILE 0.385%/21-220726	1.000.000	917.000,00	1,37
CHF SCOTIABANK CHILE 0.418%/21-310327	350.000	315.000,00	0,47

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettövermö- gens
CHF SNCF RESEAU 2%/10-121126	1.000.000	998.500,00	1,50
CHF SOCIETE GENERALE 0.375%/21-260728	1.000.000	886.000,00	1,33
CHF SOCIETE GENERALE SA 0.28%/22-260127	510.000	465.630,00	0,70
CHF SVENSKA HANDELSBANKEN 1.25%/22-240527	1.000.000	957.000,00	1,43
CHF SWEDISH EXPORT CREDIT 1.0225%/22-210927	500.000	482.250,00	0,72
CHF THE KOREA DEVELOPMENT BANK 0.445%/20-08.05.2025	1.000.000	959.500,00	1,44
CHF TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 0.5%/15-01.06.2027	500.000	470.250,00	0,70
CHF TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 1%/14-29.08.2024	300.000	296.100,00	0,44
CHF UBS AG LONDON 0.15%/21-290628	1.000.000	886.500,00	1,33
CHF VERIZON COMMUNICATIONS 1%/17-301127	500.000	469.250,00	0,70
CHF VODAFONE GROUP 0.625%/17-150327	1.000.000	944.000,00	1,41
CHF WELLS FARGO & COMPANY 0.75%/20-270525	500.000	480.250,00	0,72
CHF WESTPAC BANKING CORP 0.25%/19-29.01.2027	1.000.000	933.000,00	1,40
Total Anleihen		63.594.450,00	95,27
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		63.594.450,00	95,27
Total des Wertpapierbestandes		63.594.450,00	95,27
Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.775.042,12	4,16
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-254.653,77	-0,38
Andere Nettvermögenswerte		634.106,41	0,95
Fondsvermögen		66.748.944,76	100,00

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

Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

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

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	CHF	0,17%	/	-9,01%	-1,83%	-0,64%
B - Thesaurierend	CHF	0,17%	/	-9,02%	-1,82%	-0,64%
EB - Thesaurierend	CHF	0,33%	/	-8,43%	-1,20%	0,00%
UA - Ausschüttend	CHF	0,24%	/	-8,74%	-1,52%	-0,35%
UB - Thesaurierend	CHF	0,25%	/	-8,74%	-1,53%	-0,34%

Ausschüttungen

		Ex-Datum	Betrag
UA - Ausschüttend	CHF	17.05.2022	0,04

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

		31.03.2023			
Aktiva					
Wertpapierbestand zum Marktwert		281.683.136,99			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.606.679,64			
Forderungen aus Erträgen		1.275.558,80			
		286.565.375,43			
Passiva					
Rückstellungen für Aufwendungen		183.508,75			
		183.508,75			
Nettovermögen		286.381.866,68			
Fondsentwicklung					
		31.03.2023	31.03.2022	31.03.2021	
Fondsvermögen	CHF	286.381.866,68	318.063.229,31	574.696.617,27	
Nettoinventarwert pro Aktie					
A - Ausschüttend	CHF	248,09	259,94	275,88	
B - Thesaurierend	CHF	477,80	500,64	531,33	
EB - Thesaurierend	CHF	114,37	119,07	125,56	
UA - Ausschüttend	CHF	86,82	90,74	96,09	
UB - Thesaurierend	CHF	90,01	94,04	99,50	
Anzahl der Anteile im Umlauf					
		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	CHF	123.176,337	134.471,264	6.987,862	18.282,789
B - Thesaurierend	CHF	215.091,271	251.090,582	4.696,287	40.695,598
EB - Thesaurierend	CHF	1.307.153,778	1.288.436,764	75.839,707	57.122,693
UA - Ausschüttend	CHF	24.456,547	22.838,547	2.015,000	397,000
UB - Thesaurierend	CHF	15.943,116	20.371,710	4.760,823	9.189,417

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Fondsvermögen (in CHF)Für die Periode vom
01.04.2022 bis zum
31.03.2023

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	318.063.229,31
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.513.874,27
Bankzinsen	8.396,76
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	21.872,00
	2.544.143,03
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.486.408,18
Depotbank- und Depotgebühr	172.762,42
Zentralverwaltungsvergütung	210.326,50
Druck- und Veröffentlichungskosten	23.519,69
Zinsen und Bankspesen	16.692,33
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	96.034,00
"Taxe d'abonnement"	88.498,00
	2.094.241,12
Nettoerträge (-verluste)	449.901,91
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-2.439.454,14
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-669,51
	-2.440.123,65
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.990.221,74
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-11.400.757,58
	-11.400.757,58
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-13.390.979,32
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	13.339.846,50
Rücknahmen	-31.629.316,27
	-18.289.469,77
Ausschüttung	-913,54
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	286.381.866,68

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Frankreich	15,69
Vereinigte Staaten	13,16
Deutschland	12,15
Niederlande	9,56
Kanada	9,24
Australien	7,02
Österreich	3,98
Grossbritannien	3,38
Supranational	2,86
Finnland	2,74
Dänemark	2,51
Schweiz	2,35
Neuseeland	1,99
Schweden	1,98
Norwegen	1,45
Luxemburg	1,38
Südkorea	1,36
Venezuela	1,14
Vereinigte Arabische Emirate	1,10
Mexiko	0,99
Philippinen	0,92
Spanien	0,72
Irland	0,47
Guemsey	0,20
Island	0,00
Total	98,36

Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	55,53
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	14,11
Supranationale Organisationen	6,29
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	4,80
Kantone, Bundesländer, Provinzen	3,74
Telekommunikation	2,59
Computerhardware und Netzwerk	2,54
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	2,08
Energie- und Wasserversorgung	1,81
Petroleum	1,64
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	0,78
Verkehr und Transport	0,77
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,63
Elektrische Geräte und Komponenten	0,54
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,51
Total	98,36

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Anleihen			
CHF ABN AMRO BANK 0.3%/16-18.12.2024	3.000.000	2.887.500,00	1,01
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	2.000.000	1.999.000,00	0,70
CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025	1.000.000	957.000,00	0,33
CHF AKADEMISKA HUS 0.3%/17-08.10.2029	2.250.000	2.018.250,00	0,70
CHF AKADEMISKA HUS 1.68%/22-200932	750.000	727.875,00	0,25
CHF ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 0.25%/16-25.10.2023	1.500.000	1.483.950,00	0,52
CHF APPLE 0.375%/15-25.11.2024	5.000.000	4.885.000,00	1,71
CHF APPLE 0.75%/15-25.02.2030	2.600.000	2.399.800,00	0,84
CHF ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025	2.000.000	1.923.000,00	0,67
CHF ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75%/10-12.02.2030	2.500.000	2.647.500,00	0,92
CHF AT&T 1.875%/14-04.12.2024	2.000.000	1.977.000,00	0,69
CHF AT&T 1.875%/14-04.12.2030	600.000	585.900,00	0,20
CHF BANCO MERCANTILE DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024	3.000.000	2.827.500,00	0,99
CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	1.250.000	1.096.250,00	0,38
CHF BANK OF MONTREAL 2.26%/23-010229	600.000	592.800,00	0,21
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.1425%/21-25.10.2028	1.500.000	1.304.250,00	0,46
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.2%/18-19.11.2025	1.500.000	1.427.250,00	0,50
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.3025%/21-300731	3.000.000	2.442.000,00	0,85
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.2%/19-12.06.2026	2.250.000	2.095.875,00	0,73
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027	2.250.000	2.076.750,00	0,73
CHF BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.25%/19-24.10.2029	1.500.000	1.266.000,00	0,44
CHF BAWAG P.S.K. 2.855%/22-29.11.2027	1.500.000	1.509.750,00	0,53
CHF BEI 1.825%/12-02.04.2026	2.000.000	1.993.000,00	0,70
CHF BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028	1.000.000	891.500,00	0,31
CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	1.500.000	1.412.250,00	0,49
CHF BNG 1.25%/14-30.04.2024	4.000.000	3.976.400,00	1,39
CHF BNG 2.5%/05-21.07.2025	5.000.000	5.077.500,00	1,77
CHF BNP PARIBAS (SUBORDINATED) 1.75%/15-05.06.2025	1.000.000	981.000,00	0,34
CHF BNP PARIBAS SA 0.3%/19-15.10.2027	1.400.000	1.250.200,00	0,44
CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LB) 11%/20-24.07.2028	845.000	735.572,50	0,26
CHF CADES 2.375%/11-19.04.2023	1.000.000	1.000.400,00	0,35
CHF CAISSE DES DEPOTS ET CON 0.3%/17-12.11.2027	2.400.000	2.218.800,00	0,77
CHF CANADIAN IMP BK OF COM 0.18%/21-200429	3.000.000	2.563.500,00	0,90
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	1.000.000	914.500,00	0,32
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025	1.500.000	1.422.750,00	0,50
CHF CENTRAL AMERICAN BANK 0.2%/19-25.03.2024	2.000.000	1.964.000,00	0,69
CHF CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.405%/20-25.06.2025	1.750.000	1.679.125,00	0,59
CHF CFF 2.5%/06-24.02.2031	1.000.000	1.028.500,00	0,36
CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028	5.000	4.472,50	0,00
CHF CITIGROUP INC 0.75%/19-02.04.2026	3.500.000	3.397.935,00	1,19
CHF COCA-COLA (REG. -S-) 1%/15-02.10.2028	1.800.000	1.706.400,00	0,60
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.1575%/21-08.12.31	550.000	465.850,00	0,16
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	3.400.000	3.182.400,00	1,11
CHF COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA 1.24%/020929	340.000	322.660,00	0,11
CHF COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.5%/14-19.02.2024	1.000.000	995.200,00	0,35
CHF COOPERATIVE RABOBK UA 2.4875%/23-25.01.29	1.400.000	1.376.200,00	0,48
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	3.500.000	3.584.000,00	1,25
CHF CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.5%/15-26.02.2026	1.400.000	1.323.700,00	0,46
CHF CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/14-01.12.2028	1.000.000	941.000,00	0,33
CHF CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2%/14-05.02.2024	1.000.000	999.000,00	0,35
CHF CREDIT AGRICOLE (SUBORDINATED.) 2.125%/01-29.09.2025	500.000	489.000,00	0,17
CHF CREDIT AGRICOLE 0.625%/15-15.09.2023	1.100.000	1.093.290,00	0,38
CHF CREDIT AGRICOLE 1%/15-27.01.2025	650.000	635.375,00	0,22
CHF CREDIT AGRICOLE CIB FINANCIAL SOLUTIONS 0.1275%/20-27.07.2028	1.000.000	880.000,00	0,31
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.25%/17-27.07.2027	1.250.000	1.155.625,00	0,40
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.45%/19-24.01.2029	2.000.000	1.827.000,00	0,64
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.1%/16-26.01.2026	1.000.000	946.000,00	0,33
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026	3.500.000	3.300.500,00	1,15
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.5%/15-16.03.2027	725.000	681.500,00	0,24
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.25%/19-24.10.2029	1.000.000	890.500,00	0,31
CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 1%/19-07.11.2025	600.000	572.700,00	0,20
CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 2.125%/14-30.10.2024	1.100.000	1.095.050,00	0,38

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Ungeprüfte Informationen

Vergütung

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

Gesamtvergütung OGAW

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

Mitarbeitervergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022:

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 entrichtet von CSFM an 35 Empfänger	CHF 3.929.524,40, bestehend aus: - CHF 3.564.241,25 feste Vergütung - CHF 365.283,15 variable Vergütung
<i>Umfasst:</i>	
Vergütung der Geschäftsleitung	CHF 1.015.721,19
Vergütung von Kontrollfunktionen	CHF 516.535,07
Vergütung an andere Mitarbeiter, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der verwalteten Fonds haben	k.A. (*)

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

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 entrichtet vom OGAW-Fonds an 0 Empfänger	CHF 0, bestehend aus: - CHF 0 feste Vergütung - CHF 0 variable Vergütung
<i>Umfasst:</i>	
Vergütung der Geschäftsleitung	CHF 0
Vergütung von Kontrollfunktionen	CHF 0
Vergütung an andere Mitarbeiter, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben	CHF 0

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

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

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

Vergütung von Vertretern für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023:

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

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023, die vom OGAW an Vertreter (Tätigkeiten des Portfoliomanagements und des Risikomanagements) gezahlt wurde.	CHF 1.980.119,55 Bestehend aus: - CHF 1.980.119,55 Verwaltungsgebühren - CHF 0,00 Performancegebühren
--	---

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

Im Jahr 2022 wurden keine wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik vorgenommen.

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

Am 31.03.2023 war der Fonds an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

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

Ungeprüfte Informationen

Abwicklung und Clearing

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

Fälligkeitstermin und Sicherheiten

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

Ergänzende Informationen zu Wertpapierleihgeschäften

Zum 31.03.2023 partizipierten die Subfonds ausschliesslich am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich (der "Principal"). Der Umfang von verliehenen Wertpapieren als Teil der gesamten verleihbaren Vermögenswerte, die gemäss Definition keine Barmittel und Barmitteläquivalente umfassen, und als Teil des Nettogesamtvermögens sind der nachfolgenden Tabelle zu entnehmen. Der Umfang des Vermögens, das in Wertpapierleihgeschäften gebunden ist, und Angaben zu Sicherheiten, Rendite und Kosten sind in den Erläuterungen dieses Berichts enthalten.

Subfonds	Währung	Umfang der verliehenen Wertpapiere als Anteil vom gesamten verleihbaren Vermögen (in %)*	Summe des Wertpapierleihgeschäftes im Vergleich zum Nettoinventarwert (%)
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	3,30	3,08
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	3,61	3,58
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	1,52	1,51
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	CHF	3,54	3,38
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	5,79	5,69

* ohne Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Daten zu Emittenten von Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte

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

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

Sicherheitsemitter	Gesamtes Volumen der erhaltenen Sicherungswertpapiere und Rohstoffe pro Emittent auf Sammelkontoebene (in CHF)
FRANCE (GOVT OF)	144.154.980,90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	119.844.132,28
US TREASURY	118.922.539,40
REPUBLIC OF AUSTRIA	73.406.138,89
EUROPEAN UNION	45.946.853,61
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	43.992.130,15
BELGIUM KINGDOM	37.212.634,87
NETHERLANDS GOVERNMENT	36.967.598,32
BANK OF CHINA LTD-H	22.896.867,71
UK TREASURY	19.234.877,76

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

Subfonds	
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	1,22%
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	1,87%
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	0,72%
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	0,31%
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	2,21%

Ungeprüfte Informationen

Restlaufzeit der Sicherheit im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften

Subfonds	Währung	Fälligkeit der Sicherheit						
		Weniger als 1 Tag	Von 1 Tag bis 1 Woche	Von 1 Woche bis 1 Monat	Von 1 Monat bis 3 Monate	Von 3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration CHF Bond Fund	CHF	-	-	23.854,44	827.378,15	1.178.532,05	6.025.949,44	1.426.555,90
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration EUR Bond Fund	EUR	-	-	36.703,14	1.273.028,50	1.813.324,27	9.271.704,02	2.194.941,10
Credit Suisse (Lux) Corporate Short Duration USD Bond Fund	USD	-	-	15.295,49	530.515,75	755.676,00	3.863.845,16	914.709,15
Credit Suisse (Lux) Inflation Linked CHF Bond Fund	CHF	-	-	5.960,22	206.727,02	294.465,62	1.505.631,44	356.436,35
Credit Suisse (Lux) Swiss Franc Bond Fund	CHF	-	-	43.127,70	1.495.860,96	2.130.730,77	10.894.634,44	2.579.146,28

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

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

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

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

ANHANG IV

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

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

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300MUJYK8BC6DGI48

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 23,32% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet. Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu nachhaltigen Verfahren durch die Abdeckung der Investitionen des Subfonds durch den zentralisierten Mitwirkungsansatz von CSAM gemäss den treuhänderischen Pflichten von CSAM (aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2023. Die Daten stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren. Bitte beachten Sie, dass die Nachhaltigkeitsindikatoren am Ende des Bezugszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelt wurden.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 11,53%, AA: 42,28%, A: 24,12%, BBB: 10,95%, BB: 5,70%, B: 0,38%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: -0,12%, Keine Datenabdeckung**: 5,15%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,13	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,83	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,79	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 25,17%, Gelb: 28,70%, Orange: 36,20%, Rot: 1,13%, Nicht bewertbar**: 4,75%, Keine Datenabdeckung**: 4,05%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstoßen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 56,22%, Neutral: 42,52%, Negativ: 0,64%, Nicht bewertbar**: 0,74%, Keine Datenabdeckung**: -0,12%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

*** Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds abhängt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Zum Ende des Berichtszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen mindestens zu einem der folgenden ökologischen und/oder sozialen Ziele bei:

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

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

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

Credit Suisse Asset Management (CSAM) betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus seinem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten. Bitte beachten Sie, dass CSAM seine Kriterien für die Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen ("Do no significant harm, DNSH") am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelte.

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

Am Ende des Bezugszeitraums, d. h. zum 31.03.2023, umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

1. keinen erheblichen negativen Beitrag zum Klimawandel leisten. Bei diesem Kriterium kommt ein Indikator zum Einsatz, der die größten Emittenten von Treibhausgasen weltweit anzeigt und sich auf die PAI 1, 2, 3 und 15 bezieht.

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

2. keinen normen-, werte- und verhaltensbasierten Ausschlüssen und anderen Anlagebeschränkungen unterliegen, die sich auf die PAI 4, 10, 14 und 16 beziehen.
3. keinen schweren ESG-Kontroversen unterliegen, die sich gegebenenfalls auf die PAI 7 und 10 beziehen.
4. bei der ESG-Performance im Branchenvergleich nicht deutlich zurückliegen. Dieses Kriterium wurde angewendet, um die übrigen PAI so weit wie möglich abzudecken.

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

Die Ausrichtung der nachhaltigen Investitionen an den "OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen" und den "Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte" wurde mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt. Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



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

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen, auf den Subfonds anwendbaren PAI am Ende des Berichtszeitraums. Die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen sind eine Momentaufnahme zum Jahresenddatum der jeweiligen Umbrella-Struktur. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen. Insbesondere wurde die PAI-Methode am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission weiterentwickelt. Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
<i>Treibhausgasemissionen</i>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	18'510,87	95,28	84,36
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	3'744,62	95,28	84,36
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	138'017,22	95,28	84,36
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	160'274,58	95,28	84,36
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	417,29	95,28	84,36
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	723,82	95,28	91,12
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	10,49	95,28	91,12
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	56,04	95,28	85,66

6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	95,28	0,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	95,28	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,16	95,28	86,17
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,12	95,28	86,17
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	95,28	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	95,28	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	95,28	0,00
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	95,28	0,00
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	95,28	86,17
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	95,28	0,00
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	0,00	95,28	0,87
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	5'561,41	95,28	29,52
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	1,13	95,28	91,71
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	25,28	95,28	90,76
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	5,91	95,28	27,83
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	33,23	95,28	89,91
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	95,28	0,00
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	9,36	4,87	3,65
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	0,00	4,87	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	0,00	4,87	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

**** Die infrage kommenden Vermögenswerte und somit die Abdeckung des PAI 6 sind auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäß der SFDR beschränkt. Eine geringe Abdeckung entspricht daher nicht zwangsläufig fehlenden Daten über die Intensität des Energieverbrauchs zur Messung der PAI, sondern bedeutet stattdessen, dass die Anlagen des Portfolios nicht zu den klimaintensiven Sektoren gehören.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
NATWEST MARKETS PLC / 0,13% / 12.11.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,52	Vereinigtes Königreich
WELLS FARGO & COMPANY 1,34% / 04.05.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,52	Vereinigte Staaten von Amerika
ING GROEP NV / 0,13% / 29.11.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,45	Niederlande
MOLSON COORS BEVERAGE CO / 1,25% / 15.07.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,39	Vereinigte Staaten von Amerika
UPJOHN FINANCE BV / 1,02% / 23.06.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,38	Vereinigte Staaten von Amerika
CREDIT AGRICOLE SA (LONDON BRANCH) / 1,38% / 13.03.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,36	Frankreich
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) / 0,50% / 15.02.2026	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,35	Deutschland
UNICREDIT SPA / 1,25% / 25.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,26	Italien
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC FXD-FXD / 0,96% / 16.10.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,24	Japan
INTESA SANPAOLO SPA / 0,75% / 04.12.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,23	Italien
BNP PARIBAS SA / 2,13% / 23.01.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,23	Frankreich
AFRICA FINANCE CORP / 3,13% / 16.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,21	Afrika, supranational
Deutsche Bank AG / 1,00% / 19.11.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,20	Deutschland
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH / 0,95% / 31.12.2079	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,16	Deutschland
ABBVIE INC / 1,25% / 01.06.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,15	Vereinigte Staaten von Amerika

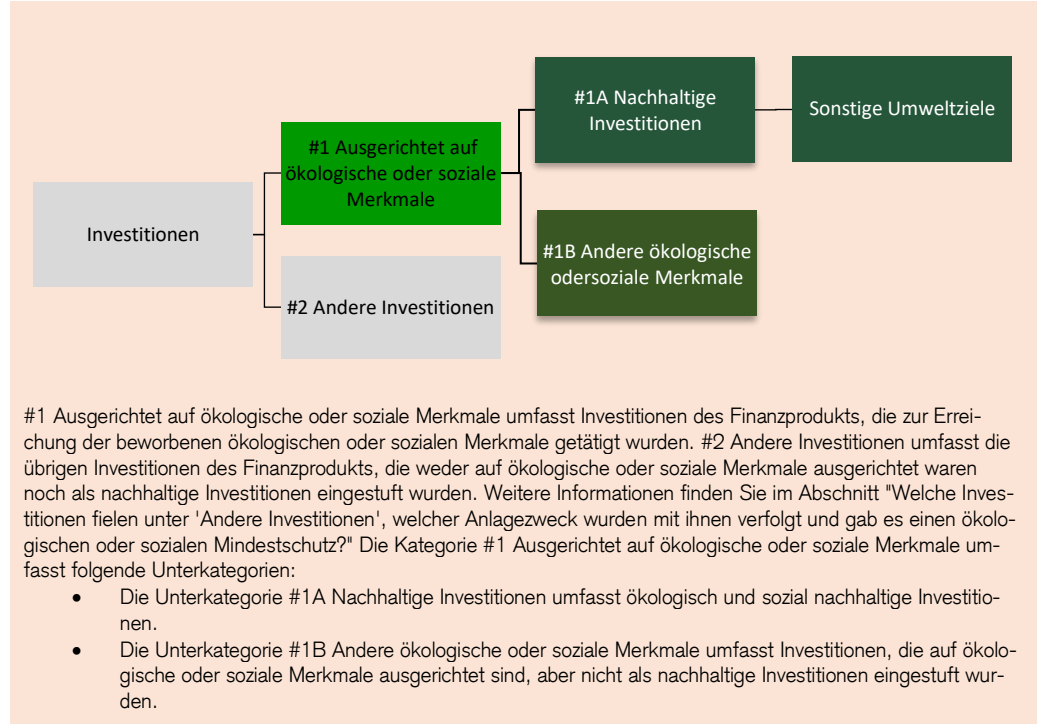
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 99,37% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 23,32% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Fondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	15,06%
D. Energieversorgung	3,47%
J. Information und Kommunikation	4,57%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	73,15%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	0,22%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	3,65%
Sonstiges	-0,12%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios. Die Kategorie "Sonstige" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Fondsengagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,00%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,31%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,72%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

Zum 31.03.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

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

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

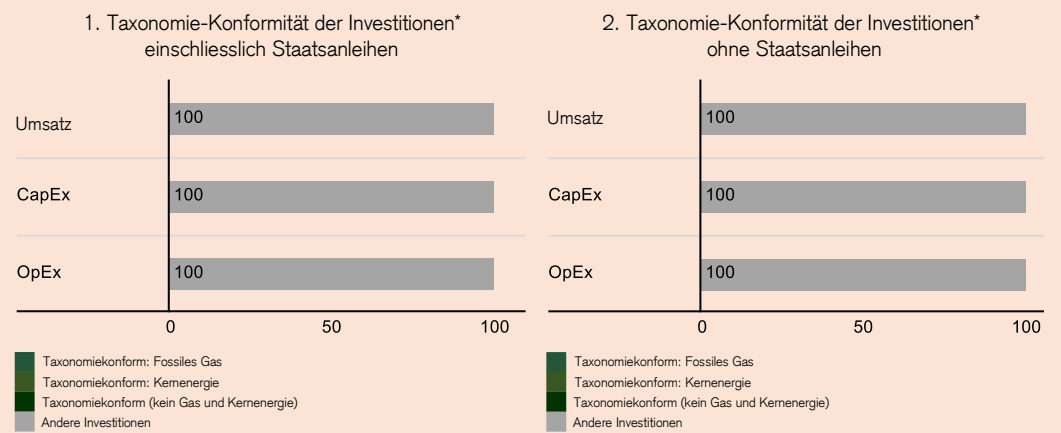
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

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



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

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

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

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

Von den 0,00% der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2023 0,00% in Übergangstätigkeiten und 0,00% in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 21,86% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

Anlagen können unter "nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel" fallen, wenn unzureichende Unternehmensdaten über die Taxonomie-Konformität zur Verfügung standen (d. h. die Unternehmen berichteten nicht über ihre EU-Taxonomie-Konformität, da sie nicht in den Geltungsbereich der Richtlinie über die Angabe nichtfinanzieller Informationen fielen) oder die EU-Taxonomie ein bestimmtes Umweltziel oder eine bestimmte Branche nicht abdeckte.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 1,46% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 0,63% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration an und wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wird. Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften.

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierausswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

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

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300GNQ87SFC7GHR34

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,68% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet. Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

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

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

- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu nachhaltigen Verfahren durch die Abdeckung der Investitionen des Subfonds durch den zentralisierten Mitwirkungsansatz von CSAM gemäss den treuhänderischen Pflichten von CSAM (aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2023. Die Daten stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren. Bitte beachten Sie, dass die Nachhaltigkeitsindikatoren am Ende des Bezugszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelt wurden.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 9,80%, AA: 39,83%, A: 20,26%, BBB: 9,98%, BB: 3,16%, B: 0,29%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,08%, Keine Datenabdeckung**: 10,59%	Anlagensexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	7,07	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,98	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,87	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 35,31%, Gelb: 19,37%, Orange: 27,47%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 11,33%, Keine Datenabdeckung**: 6,51%	Anlagensexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 50,88%, Neutral: 37,28%, Negativ: 4,62%, Nicht bewertbar**: 0,96%, Keine Datenabdeckung**: 6,27%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

*** Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds abhängt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Zum Ende des Berichtszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen mindestens zu einem der folgenden ökologischen und/oder sozialen Ziele bei:

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

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

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

Credit Suisse Asset Management (CSAM) betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus seinem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten. Bitte beachten Sie, dass CSAM seine Kriterien für die Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen ("Do no significant harm, DNSH") am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelte.

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

Am Ende des Bezugszeitraums, d. h. zum 31.03.2023, umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

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

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen**

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

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

Die Ausrichtung der nachhaltigen Investitionen an den "OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen" und den "Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte" wurde mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt. Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



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

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen, auf den Subfonds anwendbaren PAI am Ende des Berichtszeitraums. Die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen sind eine Momentaufnahme zum Jahresenddatum der jeweiligen Umbrella-Struktur. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen. Insbesondere wurde die PAI-Methode am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission weiterentwickelt. Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1'375,92	88,83	66,66
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	941,92	88,83	66,66
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	29'610,67	88,83	66,66
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	31'775,38	88,83	65,65
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	107,93	88,83	65,65
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	394,16	88,83	79,07
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	1,31	88,83	81,09
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	46,43	88,83	70,91
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	0,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	72,84
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	88,83	72,84

6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	72,84
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	0,00
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,83	72,84
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	88,83	0,00
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	0,00	88,83	0,00
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	13,07	88,83	14,29
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	88,83	0,00
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	30,20	88,83	81,09
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	4,91	88,83	17,86
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	28,95	88,83	79,10
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	88,83	0,00
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	0,11	2,28	11,88
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0,00	2,28	11,88
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	2,28	11,88
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

**** Die infrage kommenden Vermögenswerte und somit die Abdeckung des PAI 6 sind auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäss der SFDR beschränkt. Eine geringe Abdeckung entspricht daher nicht zwangsläufig fehlenden Daten über die Intensität des Energieverbrauchs zur Messung der PAI, sondern bedeutet stattdessen, dass die Anlagen des Portfolios nicht zu den klimaintensiven Sektoren gehören.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
BARCLAYS PLC / 1,13% / 12.07.2023	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,41	Vereinigtes Königreich
CBQ FINANCE LTD / 0,73% / 27.11.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,99	Katar
CITIGROUP INC / 0,50% / 22.11.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,66	Vereinigte Staaten von Amerika
COOPERATIEVE RABOBANK UA / 3,13% / 15.09.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,42	Niederlande
GRANDE DIXENCE SA / 1,25% / 06.06.2023	D. Energieversorgung	1,38	Schweiz
BNP PARIBAS SA / 1,75% / 05.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,36	Frankreich
AT&T INC / 1,38% / 04.12.2024	J. Information und Kommunikation	1,36	Vereinigte Staaten von Amerika
BCO CREDITO INVS / 0,40% / 22.11.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,32	Chile
ASB FINANCE LTD (LONDON BRANCH) / 0,45% / 30.01.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,32	Australien
BLACK SEA TRADE AND DEVELOPMENT BANK / 0,45% / 13.06.2023	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,31	Supranational
BANK OF AMERICA CORP / 0,25% / 12.06.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,29	Vereinigte Staaten von Amerika
HEATHROW FUNDING LTD / 0,50% / 17.05.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,18	Vereinigtes Königreich
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT / 0,25% / 10.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,17	Frankreich
BANK OF AMERICA CORP / 0,17% / 18.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,14	Korea, Republik
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PT / 0,63% / 23.06.2023	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,13	Australien

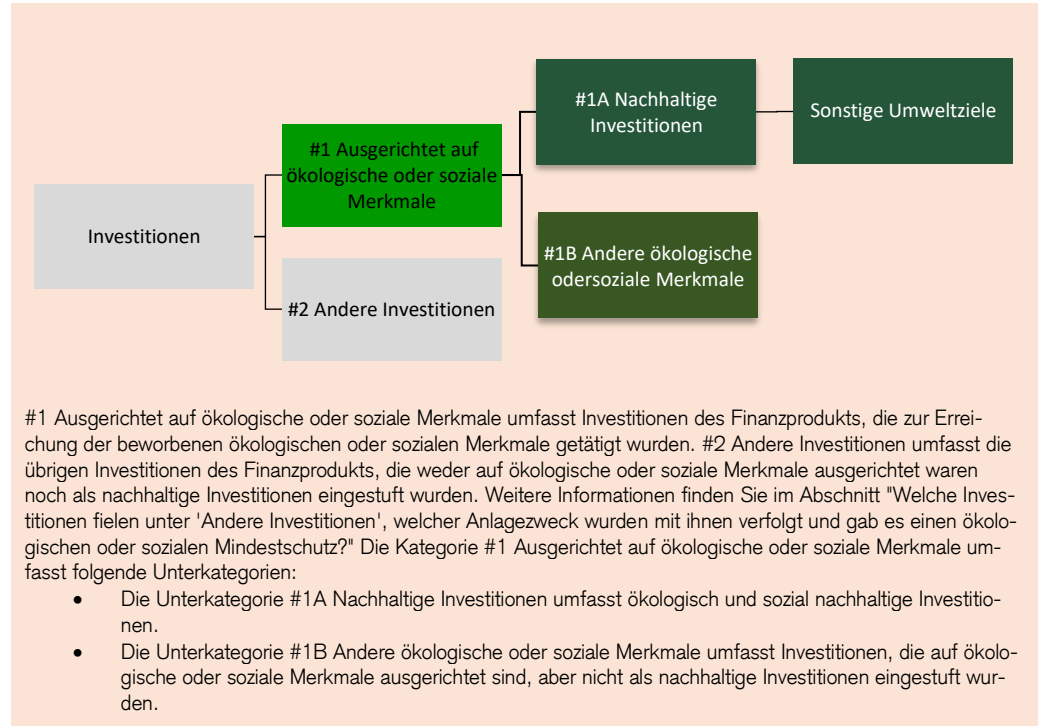
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 90,58% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 10,68% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,00%
C. Verarbeitendes Gewerbe	3,05%
D. Energieversorgung	4,08%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,35%
I. Gastgewerbe	1,51%
J. Information und Kommunikation	5,66%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	71,00%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	0,28%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,68%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,39%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,13%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,87%
Sonstiges	7,99%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios. Die Kategorie "Sons-tige" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeit-punkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Fondsendagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

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

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

Zum 31.03.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

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

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

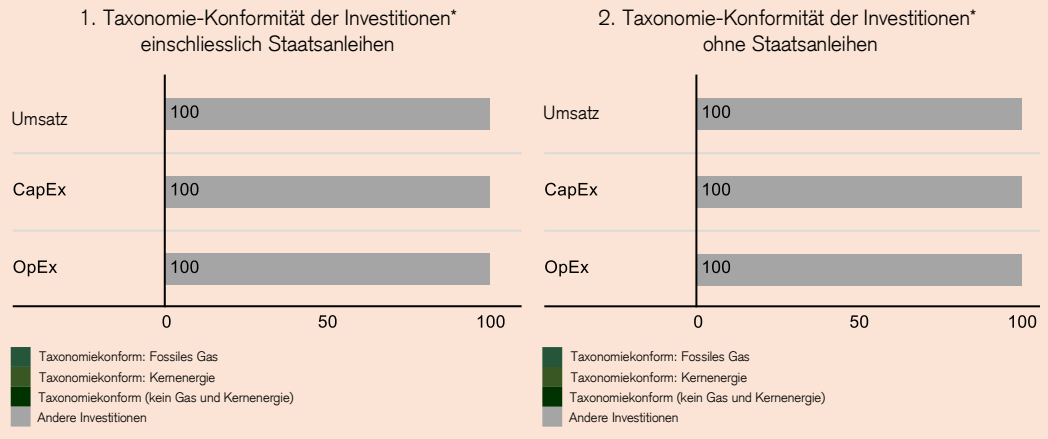
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

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



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

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

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

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

Von den 0,00% der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2023 0,00% in Übergangstätigkeiten und 0,00% in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 10,68% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

Anlagen können unter "nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel" fallen, wenn unzureichende Unternehmensdaten über die Taxonomie-Konformität zur Verfügung standen (d. h. die Unternehmen berichteten nicht über ihre EU-Taxonomie-Konformität, da sie nicht in den Geltungsbereich der Richtlinie über die Angabe nichtfinanzieller Informationen fielen) oder die EU-Taxonomie ein bestimmtes Umweltziel oder eine bestimmte Branche nicht abdeckte.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 9,42% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration an und wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wird. Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



sind

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften.

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

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

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300XTAJVSK80V2877

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 15,42% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet. Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu nachhaltigen Verfahren durch die Abdeckung der Investitionen des Subfonds durch den zentralisierten Mitwirkungsansatz von CSAM gemäss den treuhänderischen Pflichten von CSAM (aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2023. Die Daten stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren. Bitte beachten Sie, dass die Nachhaltigkeitsindikatoren am Ende des Bezugszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelt wurden.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 6,37%, AA: 32,40%, A: 39,50%, BBB: 12,45%, BB: 4,73%, B: 3,09%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: -0,12%, Keine Datenabdeckung**: 1,59%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,76	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,94	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,52	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 24,39%, Gelb: 22,10%, Orange: 40,92%, Rot: 0,31%, Nicht bewertbar**: 10,69%, Keine Datenabdeckung**: 1,59%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstoßen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 38,76%, Neutral: 55,96%, Negativ: 3,09%, Nicht bewertbar: 0,89%, Keine Datenabdeckung **: 1,66%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

*** Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds abhängt.

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

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

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

Zum Ende des Berichtszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen mindestens zu einem der folgenden ökologischen und/oder sozialen Ziele bei:

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

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

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

Credit Suisse Asset Management (CSAM) betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus seinem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten. Bitte beachten Sie, dass CSAM seine Kriterien für die Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen ("Do no significant harm, DNSH") am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelte.

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

Am Ende des Bezugszeitraums, d. h. zum 31.03.2023, umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

1. keinen erheblichen negativen Beitrag zum Klimawandel leisten. Bei diesem Kriterium kommt ein Indikator zum Einsatz, der die größten Emittenten von Treibhausgasen weltweit anzeigt und sich auf die PAI 1, 2, 3 und 15 bezieht.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen**

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

2. keinen normen-, werte- und verhaltensbasierten Ausschlüssen und anderen Anlagebeschränkungen unterliegen, die sich auf die PAI 4, 10, 14 und 16 beziehen.
3. keinen schweren ESG-Kontroversen unterliegen, die sich gegebenenfalls auf die PAI 7 und 10 beziehen.
4. bei der ESG-Performance im Branchenvergleich nicht deutlich zurückliegen. Dieses Kriterium wurde angewendet, um die übrigen PAI so weit wie möglich abzudecken.

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

Die Ausrichtung der nachhaltigen Investitionen an den "OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen" und den "Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte" wurde mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt. Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



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

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen, auf den Subfonds anwendbaren PAI am Ende des Berichtszeitraums. Die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen sind eine Momentaufnahme zum Jahresenddatum der jeweiligen Umbrella-Struktur. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen. Insbesondere wurde die PAI-Methode am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission weiterentwickelt. Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
<i>Treibhausgasemissionen</i>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	7'436,47	88,91	84,27
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2'440,68	88,91	84,27
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	110'871,46	88,91	83,58
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	120'721,05	88,91	83,58
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	344,88	88,91	83,58
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	664,08	88,91	86,63
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	9,68	88,91	86,63
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	47,98	88,91	76,42

6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,91	0,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,91	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,08	88,91	80,16
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,05	88,91	80,16
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,91	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,91	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,91	80,16
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,04	88,91	80,16
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,91	80,16
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	88,91	0,00
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	0,00	88,91	0,00
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	2'121,82	88,91	19,48
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,31	88,91	87,32
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	36,80	88,91	86,46
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	5,13	88,91	22,87
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	29,39	88,91	86,11
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	88,91	0,00
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	29,06	11,27	9,60
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	0,00	11,27	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	0,00	11,27	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

**** Die infrage kommenden Vermögenswerte und somit die Abdeckung des PAI 6 sind auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäß der SFDR beschränkt. Eine geringe Abdeckung entspricht daher nicht zwangsläufig fehlenden Daten über die Intensität des Energieverbrauchs zur Messung der PAI, sondern bedeutet stattdessen, dass die Anlagen des Portfolios nicht zu den klimaintensiven Sektoren gehören.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
UNITED STATES TREASURY / 3,88% / 31.12.2027	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	2,13	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 3,50% / 31.01.2028	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,83	Vereinigte Staaten von Amerika
TREASURY BILL / 28.09.2023	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,79	Vereinigte Staaten von Amerika
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE / 3,50% / 01.04.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,52	Vereinigte Staaten von Amerika
JPMORGAN CHASE & CO / 2,00% / 13.03.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,48	Vereinigte Staaten von Amerika
MORGAN STANLEY / 4,00% / 23.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,42	Vereinigte Staaten von Amerika
WELLS FARGO & COMPANY 3,91% / 25.04.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,29	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,75% / 15.05.2025	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,29	Vereinigte Staaten von Amerika
LLOYDS BANKING GROUP PLC / 3,87% / 09.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,28	Vereinigtes Königreich
AERCAP IRLAND CAPITAL DAC / 1,75% / 29.10.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,23	Irland
AFRICA FINANCE CORP / 3,13% / 16.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,21	Afrika, supranational
BANK OF AMERICA CORP / 4,83% / 22.07.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,17	Vereinigte Staaten von Amerika
BANK OF AMERICA CORP / 2,46% / 22.10.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,13	Vereinigte Staaten von Amerika
JPMORGAN CHASE & CO / 0,56% / 16.02.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,13	Vereinigte Staaten von Amerika
SUMITOMO MITSUI FIN GRP INC / 0,95% / 12.01.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,06	Japan

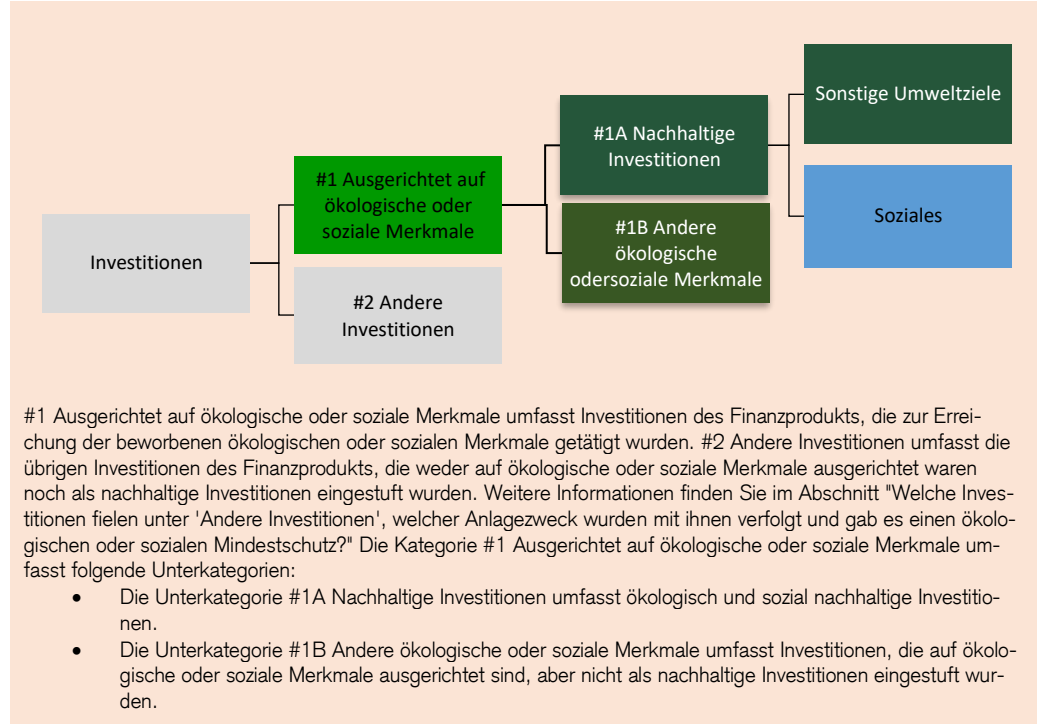
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 99,23% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 15,42% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Fondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	12,39%
D. Energieversorgung	1,05%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,02%
H. Verkehr und Lagerei	1,66%
J. Information und Kommunikation	6,15%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	62,23%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	0,48%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,01%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	9,60%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,66%
Sonstiges	0,76%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios. Die Kategorie

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

Fondsendagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,00%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,00%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,14%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	1,05%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

Zum 31.03.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

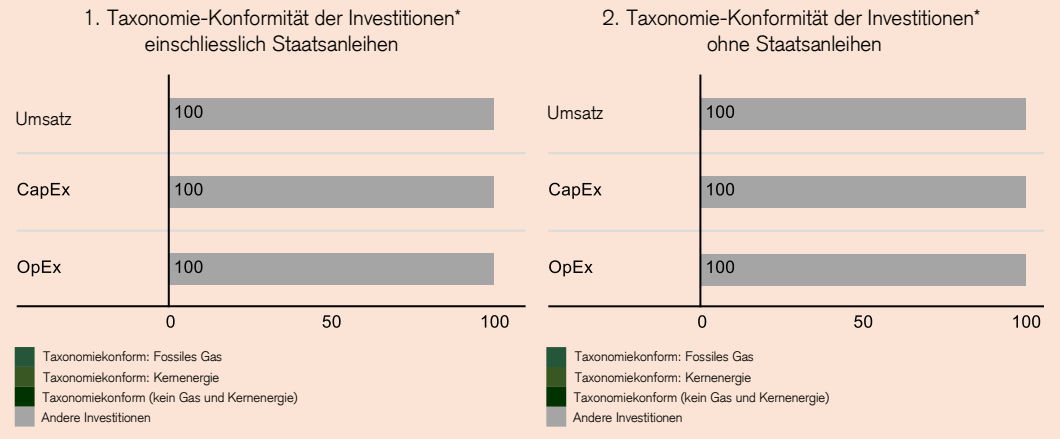
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

Von den 0,00% der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2023 0,00% in Übergangstätigkeiten und 0,00% in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 12,26% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

Anlagen können unter "nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel" fallen, wenn unzureichende Unternehmensdaten über die Taxonomie-Konformität zur Verfügung standen (d. h. die Unternehmen berichteten nicht über ihre EU-Taxonomie-Konformität, da sie nicht in den Geltungsbereich der Richtlinie über die Angabe nichtfinanzieller Informationen fielen) oder die EU-Taxonomie ein bestimmtes Umweltziel oder eine bestimmte Branche nicht abdeckte.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 3,16% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 0,77% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration an und wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wird. Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



sind

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften.

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

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

Unternehmenskennung (LEI-Code):

UOEKF78I2YA2ISJ3Q773

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 7,52% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet. Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen

Das Team für aktives Aktionärstum bestimmte die Themen und Probleme, die CSAM mit diesen Unternehmen erörtern wollte. Die daraus resultierenden Engagementaktivitäten für den Berichtszeitraum dieses SFDR-Anhangs zum Jahresbericht wurden mithilfe bestimmter Kriterien festgelegt und zielten auf Unternehmen ab, an denen CSAM über seine Fonds erhebliche Beteiligungen hielt. Für den Bezugszeitraum vom 01.04.2022 bis 31.03.2023 hielt dieser Subfonds keine zugrunde liegenden Vermögenswerte, die Gegenstand von Engagementaktivitäten von CSAM waren. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2023. Die Daten stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren. Bitte beachten Sie, dass die Nachhaltigkeitsindikatoren am Ende des Bezugszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelt wurden.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 11,36%, AA: 36,25%, A: 26,76%, BBB: 8,10%, BB: 7,66%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 3,73%, Keine Datenabdeckung**: 6,13%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,98	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,84	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,96	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 27,96%, Gelb: 22,09%, Orange: 32,69%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 9,56%, Keine Datenabdeckung**: 7,69%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM**	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 47,62%, Neutral: 46,19%, Negativ: 2,68%, Nicht bewertbar**: 0,45%, Keine Datenabdeckung**: 3,06%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

*** Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds abhängt.

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

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

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

Zum Ende des Berichtszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen mindestens zu einem der folgenden ökologischen und/oder sozialen Ziele bei:

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

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

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

Obwohl dieser Subfonds keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen anstrebt, verwendete CSAM verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus seinem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten. Bitte beachten Sie, dass CSAM seine Kriterien für die Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen ("Do no significant harm, DNSH") am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelte.

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

Am Ende des Bezugszeitraums, d. h. zum 31.03.2023, umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

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

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

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

Die Ausrichtung der nachhaltigen Investitionen an den "OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen" und den "Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte" wurde mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt. Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



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

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen, auf den Subfonds anwendbaren PAI am Ende des Berichtszeitraums. Die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen sind eine Momentaufnahme zum Jahresenddatum der jeweiligen Umbrella-Struktur. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen. Insbesondere wurde die PAI-Methode am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission weiterentwickelt. Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	331,67	83,51	57,92
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	73,83	83,51	57,92
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	4'739,39	83,51	57,92
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	5'105,66	83,51	56,77
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	76,42	83,51	56,77
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	350,99	83,51	71,54
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	1,16	83,51	77,83
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	46,24	83,51	69,09
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,51	0,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,51	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	83,51	70,47
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	83,51	70,47

6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,51	0,00
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,51	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,51	0,00
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,51	70,47
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,51	0,00
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	83,51	0,00
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	0,00	83,51	0,00
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	1,95	83,51	8,00
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	83,51	0,00
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	28,98	83,51	77,83
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	4,30	83,51	18,30
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	29,43	83,51	72,69
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	83,51	0,00
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	1,31	12,76	0,77
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	0,00	12,76	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	0,00	12,76	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

**** Die infrage kommenden Vermögenswerte und somit die Abdeckung des PAI 6 sind auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäss der SFDR beschränkt. Eine geringe Abdeckung entspricht daher nicht zwangsläufig fehlenden Daten über die Intensität des Energieverbrauchs zur Messung der PAI, sondern bedeutet stattdessen, dass die Anlagen des Portfolios nicht zu den klimaintensiven Sektoren gehören.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
EUROPEAN INVESTMENT BANK / 1,63% / 02.04.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,29	Supranational
ORANGE SA / 0,20% / 24.11.2025	J. Information und Kommunikation	1,87	Frankreich
BANK OF AMERICA CORP / 0,17% / 18.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,87	Korea, Republik
BANK OF AMERICA CORP / 0,25% / 12.06.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,85	Vereinigte Staaten von Amerika
BNG BANK NV / 2,50% / 21.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,81	Niederlande
APPLE INC / 0,38% / 25.11.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,77	Vereinigte Staaten von Amerika
NORDEA BANK ABP / 0,55% / 23.06.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,75	Finnland
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMER / 0,28% / 03.02.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,66	Kanada
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMER / 0,05% / 15.10.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,66	Kanada
SNCF RESEAU / 2,00% / 12.11.2026	H. Verkehr und Lagerei	1,52	Frankreich
CITIGROUP INC / 0,75% / 02.04.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,51	Vereinigte Staaten von Amerika
QUEBEC (PROVINCE OF) / 0,75% / 21.11.2024	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,48	Kanada
HYPOTHEKARLBERG BANK AG / 0,45% / 05.03.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,48	Österreich
CREDIT AGRICOLE SA (LONDON BRANCH) / 1,00% / 27.01.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,48	Frankreich
MCDONALDS CORP / 0,17% / 04.10.2024	I. Gastgewerbe	1,47	Vereinigte Staaten von Amerika

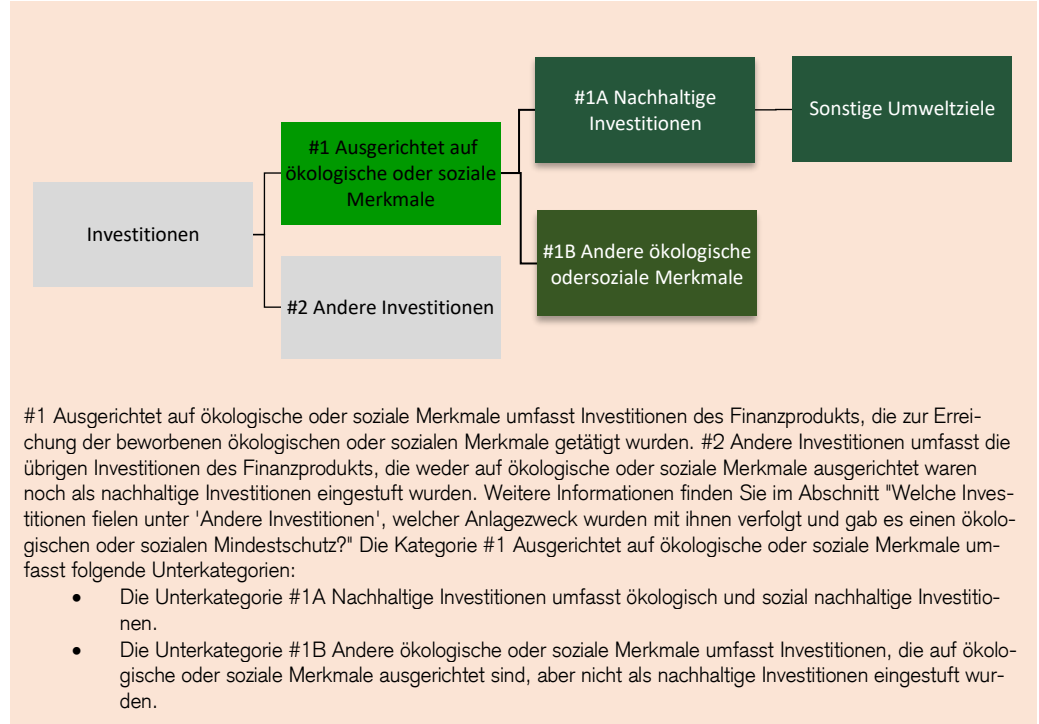
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 95,82% seines Gesamtvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 7,52% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
C. Verarbeitendes Gewerbe	5,19%
D. Energieversorgung	1,02%
H. Verkehr und Lagerei	1,52%
I. Gastgewerbe	1,47%
J. Information und Kommunikation	4,01%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	77,31%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	6,67%
Sonstiges	2,81%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios. Die Kategorie "Sonstige" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Fondsengagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

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

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

Zum 31.03.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

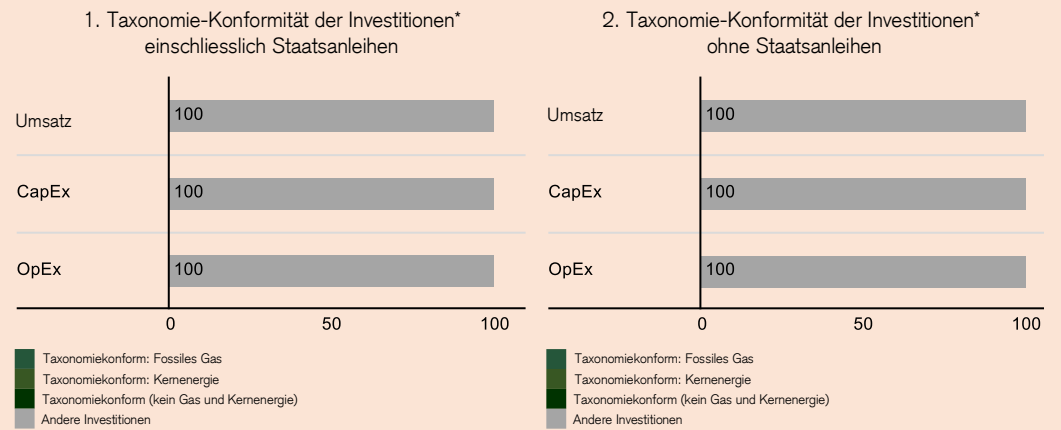
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

Von den 0,00% der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2023 0,00% in Übergangstätigkeiten und 0,00% in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 7,52% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

Anlagen können unter "nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel" fallen, wenn unzureichende Unternehmensdaten über die Taxonomie-Konformität zur Verfügung standen (d. h. die Unternehmen berichteten nicht über ihre EU-Taxonomie-Konformität, da sie nicht in den Geltungsbereich der Richtlinie über die Angabe nichtfinanzieller Informationen fielen) oder die EU-Taxonomie ein bestimmtes Umweltziel oder eine bestimmte Branche nicht abdeckte.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 4,18% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration an und wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wird. Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften.

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

Für den Berichtszeitraum vom 01.04.2022 bis 31.03.2023 hielt dieser Subfonds keine zugrunde liegenden Vermögenswerte, die Gegenstand von Engagementaktivitäten waren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: CS (Lux) Swiss Franc Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): Z06LKJMJQL1LACKX1P67

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel ___% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 12,93% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

Die Verwaltungsgesellschaft und der Anlageverwalter haben die Richtlinien von Credit Suisse Asset Management (CSAM) für nachhaltiges Investieren (CSAM Sustainable Investing Policy) auf diesen Subfonds angewendet. Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal für festverzinsliche Anlagen
- Beitrag zu nachhaltigen Verfahren durch die Abdeckung der Investitionen des Subfonds durch den zentralisierten Mitwirkungsansatz von CSAM gemäss den treuhänderischen Pflichten von CSAM (aktives Aktionärstum)

Inwieweit die ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, wird durch die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Es wurden keine Derivate eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle zeigt die Leistung der auf diesen Subfonds anwendbaren Nachhaltigkeitsindikatoren zum 31.03.2023. Die Daten stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren. Bitte beachten Sie, dass die Nachhaltigkeitsindikatoren am Ende des Bezugszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelt wurden.

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 10,22%, AA: 40,17%, A: 30,60%, BBB: 9,45%, BB: 5,24%, B: 0,00%, CCC: 0,00%, Nicht bewertbar**: 1,17%, Keine Datenabdeckung**: 3,15%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,85	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	4,94	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	6,17	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 41,60%, Gelb: 20,80%, Orange: 22,17%, Rot: 0,00%, Nicht bewertbar**: 6,90%, Keine Datenabdeckung**: 8,52%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstoßen. Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 50,66%, Neutral: 48,14%, Negativ: 0,00%, Nicht bewertbar**: 0,03%, Keine Datenabdeckung**: 1,17%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

*** Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds abhängt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Zum Ende des Berichtszeitraums trugen die nachhaltigen Investitionen mindestens zu einem der folgenden ökologischen und/oder sozialen Ziele bei:

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

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

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

Credit Suisse Asset Management (CSAM) betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus seinem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten. Bitte beachten Sie, dass CSAM seine Kriterien für die Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen ("Do no significant harm, DNSH") am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission entwickelte.

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

Am Ende des Bezugszeitraums, d. h. zum 31.03.2023, umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

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

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

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

Die Ausrichtung der nachhaltigen Investitionen an den "OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen" und den "Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte" wurde mithilfe des CS-Rahmenwerks für Geschäftsverhalten als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt. Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



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

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen, auf den Subfonds anwendbaren PAI am Ende des Berichtszeitraums. Die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen sind eine Momentaufnahme zum Jahresenddatum der jeweiligen Umbrella-Struktur. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Werte der Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen. Insbesondere wurde die PAI-Methode am Ende des Berichtszeitraums unter Berücksichtigung der ab 01.01.2023 geltenden Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission weiterentwickelt. Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	3'340,12	77,57	50,60
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	522,90	77,57	50,60
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	37'413,76	77,57	50,60
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	41'200,51	77,57	50,08
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	142,85	77,57	50,08
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	484,86	77,57	70,21
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	4,07	77,57	73,27
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	47,24	77,57	64,56
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	77,57	0,00
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	77,57	0,00
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	77,57	65,19
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,05	77,57	65,19
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	77,57	0,00

6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	77,57	0,00
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	77,57	0,00
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	77,57	65,19
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	77,57	0,00
Biodiversität			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	77,57	0,00
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	0,00	77,57	0,00
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	20,29	77,57	11,13
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,00	77,57	0,00
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	20,28	77,57	73,27
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,09	77,57	9,47
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	27,26	77,57	69,80
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	77,57	0,00
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	4,66	21,25	2,73
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	0,00	21,25	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	0,00	21,25	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

**** Die in Frage kommenden Vermögenswerte und somit die Abdeckung des PAI 6 sind auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäß der SFDR beschränkt. Eine geringe Abdeckung entspricht daher nicht zwangsläufig fehlenden Daten über die Intensität des Energieverbrauchs zur Messung der PAI, sondern bedeutet stattdessen, dass die Anlagen des Portfolios nicht zu den klimaintensiven Sektoren gehören.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2023

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
KFW / 2,50% / 25.08.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,71	Deutschland
BNG BANK NV / 2,50% / 21.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,80	Niederlande
APPLE INC / 0,38% / 25.11.2024	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,71	Vereinigte Staaten von Amerika
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY / 11.07.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,50	Vereinigtes Königreich
BNG BANK NV / 1,25% / 30.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,41	Niederlande
COOPERATIEVE RABOBANK UA / 3,13% / 15.09.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,27	Niederlande
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD / 0,13% / 21.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,27	Australien
KOMMUNEKREDIT / 0,63% / 09.07.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,25	Dänemark
CITIGROUP INC / 0,75% / 02.04.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,20	Vereinigte Staaten von Amerika
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH / 0,45% / 08.11.2030	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,18	Deutschland
CREDIT SUISSE AG (LONDON BRANCH) / 0,55% / 15.04.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,17	Schweiz
KOMMUNEKREDIT / 2,88% / 13.10.2031	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,16	Dänemark
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH / 0,25% / 18.06.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,16	Frankreich
WESTPAC BANKING CORP / 0,25% / 29.01.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,14	Australien
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA / 0,40% / 25.09.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,11	Australien

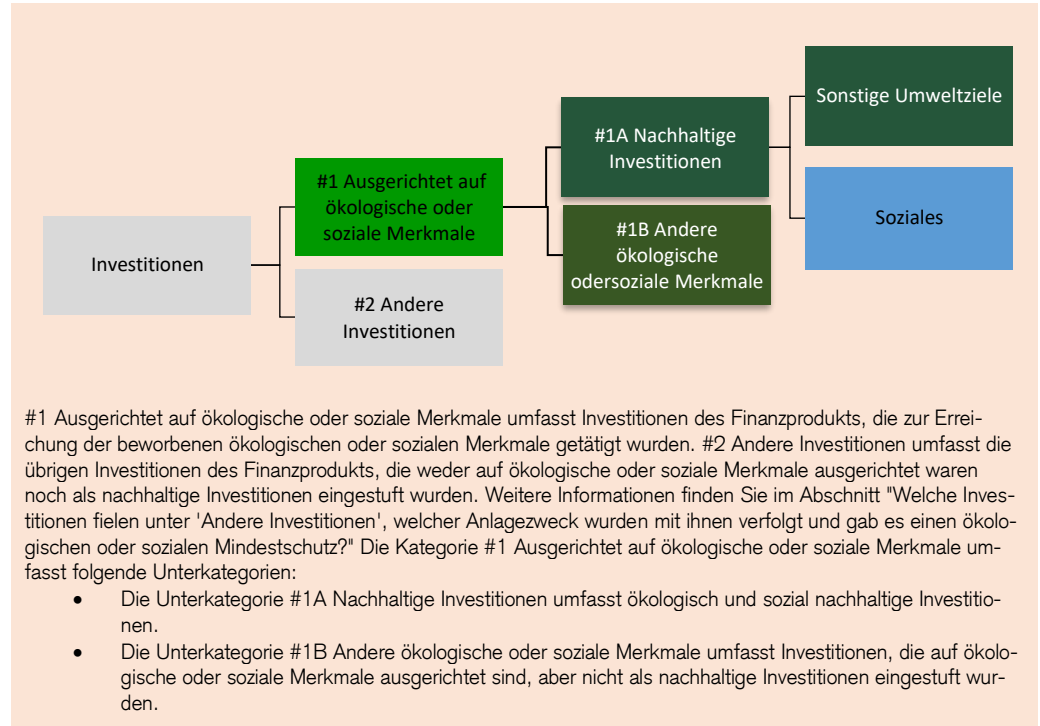
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 98,80% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 12,93% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,69%
C. Verarbeitendes Gewerbe	5,43%
D. Energieversorgung	2,54%
H. Verkehr und Lagerei	1,25%
I. Gastgewerbe	0,51%
J. Information und Kommunikation	2,60%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	76,33%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	1,30%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	5,67%
U. Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,93%
Sonstiges	1,76%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios. Die Kategorie "Sonstige" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und

den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Fondsenagement in Teilsektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,61%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	1,08%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,00%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,00%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,17%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzeugnissen	0,00%

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

** Portfolioengagement zum 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

Zum 31.03.2023 waren 0,00% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

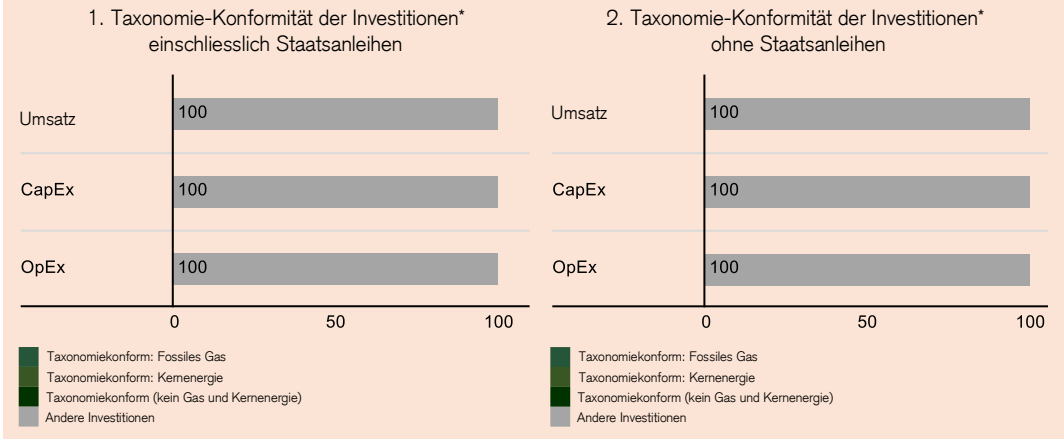
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

Von den 0,00% der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2023 0,00% in Übergangstätigkeiten und 0,00% in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 12,15% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

Anlagen können unter "nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel" fallen, wenn unzureichende Unternehmensdaten über die Taxonomie-Konformität zur Verfügung standen (d. h. die Unternehmen berichteten nicht über ihre EU-Taxonomie-Konformität, da sie nicht in den Geltungsbereich der Richtlinie über die Angabe nichtfinanzieller Informationen fielen) oder die EU-Taxonomie ein bestimmtes Umweltziel oder eine bestimmte Branche nicht abdeckte.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 0,79% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 1,20% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration an und wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wird. Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Die Anlageverwalter nutzten externe Wesentlichkeitsrahmen, um die relevanten ESG-Faktoren für den Subfonds festzustellen. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften.

- ESG-Wertpapieranalyse

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

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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

- Portfolioüberwachung

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

- Mitwirkung

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

MSCI-Haftungsausschluss

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

JESG-Haftungsausschluss

Mittels der Methode von J.P. Morgan ESG (JESG), die vom Indexanbieter auf den JPM ESG EMBI Global Diversified Index angewendet wird, berechnen die Credit Suisse Group AG und/oder ihre verbundenen Unternehmen (nachfolgend die "Parteien") das ESG-Rating des Portfolios und das Warnsignal ESG-Kontroversen. Die Angaben zum ESG-Rating des Index und zum Warnsignal ESG-Kontroversen stammen aus Quellen, die die Parteien als zuverlässig erachten. Es kann jedoch keine der Parteien für die Echtheit, Genauigkeit und/oder Vollständigkeit der erhaltenen Informationen haftbar gemacht werden, da die Parteien die Angaben nicht unabhängig prüfen.

NACE-Quelle

Eurostat

ESG-Erläuterungen

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



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