

CS Investment Funds 12

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital

luxemburgischen Rechts – R.C.S. K671

**Geprüfter Jahresbericht
zum 31.03.2024**

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
Prüfungsvermerk	4
Kombinierter Bericht	10
Erläuterungen	12
Tätigkeitsbericht (ungeprüft)	15
Bericht per Subfonds	
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	16
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	21
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	27
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	32
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	37
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	42
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	47
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	52
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	58
Ungeprüfte Angaben	63
Vergütung	63
Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")	63
Transparenz bei der Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen	65

Verwaltung und Organe

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

Thomas Nummer (bis zum 30.04.2023)
Independent Director, Luxemburg

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

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

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

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

Depotbank und Zahlstelle

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

Zentrale Verwaltungsstelle

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

Abschlussprüfer

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

Anlageverwalter

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

- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD

Co-Anlageverwalter:
Credit Suisse (Italy) S.p.A.
Società di Gestione del Risparmio
Via Santa Margherita, 3, I-20121 Milan

- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR

Rechtsberater

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

Vertriebsstelle

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

Vertreter in der Schweiz

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

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

Zahlstelle in der Schweiz

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

Vertreter und Zahlstellen ausserhalb von Luxemburg und der Schweiz

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

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

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

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



Audit report

To the Unitholders of
CS Investment Funds 12

Our opinion

In our opinion, the accompanying financial statements give a true and fair view of the financial position of CS Investment Funds 12 (the "Fund") and of each of its sub-funds as at 31 March 2024, and of the results of their operations and changes in their net assets for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements.

What we have audited

The Fund's financial statements comprise:

- the Combined Statement of Net Assets for the Fund and the Statement of Net Assets for each of the sub-funds as at 31 March 2024;
- the Combined Statement of Operations / Changes in Net Assets for the Fund and the Statement of Operations / Changes in Net Assets for each of the sub-funds for the year then ended;
- the Statement of Investments in Securities for each of the sub-funds as at 31 March 2024; and
- the notes to the financial statements, which include a summary of significant accounting policies.

Basis for opinion

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

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

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

Emphasis of matter

We draw attention to Note "Summary of significant accounting policies" and the Note "Subsequent events" to these financial statements, which indicates that all sub-funds have been merged post-closing. These financial statements have therefore been prepared using a non-going concern basis of accounting. Our opinion is not modified in respect of this matter.

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

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



Other information

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

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

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

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

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

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

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

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



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

- identify and assess the risks of material misstatement of the financial statements, whether due to fraud or error, design and perform audit procedures responsive to those risks, and obtain audit evidence that is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion. The risk of not detecting a material misstatement resulting from fraud is higher than for one resulting from error, as fraud may involve collusion, forgery, intentional omissions, misrepresentations, or the override of internal control;
- obtain an understanding of internal control relevant to the audit in order to design audit procedures that are appropriate in the circumstances, but not for the purpose of expressing an opinion on the effectiveness of the Fund's internal control;
- evaluate the appropriateness of accounting policies used and the reasonableness of accounting estimates and related disclosures made by the Board of Directors of the Management Company;
- conclude on the appropriateness of the Board of Directors of the Management Company's use of the going concern basis of accounting and, based on the audit evidence obtained, whether a material uncertainty exists related to events or conditions that may cast significant doubt on the Fund's or any of its sub-funds' ability to continue as a going concern. If we conclude that a material uncertainty exists, we are required to draw attention in our audit report to the related disclosures in the financial statements or, if such disclosures are inadequate, to modify our opinion. Our conclusions are based on the audit evidence obtained up to the date of our audit report;
- evaluate the overall presentation, structure and content of the financial statements, including the disclosures, and whether the financial statements represent the underlying transactions and events in a manner that achieves fair presentation.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Represented by

Luxembourg, 10 July 2024

Sandra Paulis



Bestätigungsvermerk des Abschlussprüfers

An die Anteilseigner des
CS Investment Funds 12

Unser Prüfungsurteil

Unserer Ansicht nach vermittelt der beiliegende Jahresabschluss ein getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage des CS Investment Funds 12 (der "Fonds") und seiner einzelnen Subfonds zum 31. März 2024 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögens für das abgeschlossene Jahr gemäß den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften zur Erstellung und Darstellung von Finanzausweisen.

Art und Umfang unserer Prüfungshandlungen

Zum Jahresabschluss gehören:

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

Grundlage unserer Einschätzung

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

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

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

Hervorhebung eines Sachverhalts

Wir weisen auf die Anmerkung "Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze" und die Anmerkung "Ereignisse nach dem Bilanzstichtag" zu diesem Jahresabschluss hin, aus denen hervorgeht, dass alle Subfonds nach der Ende des Berichtszeitraums verschmolzen wurden. Dieser Abschluss wurde daher unter der Annahme der Nicht-Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt. Dieser Sachverhalt hat keine Auswirkung auf die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks.

Sonstige Angaben

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

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

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

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss

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

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

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

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



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

- Das Risiko wesentlicher Fehldarstellungen im Abschluss einzuschätzen, sei es auf Grund beabsichtigter oder unbeabsichtigter Fehler, für dieses Risiko Prüfverfahren zu konzipieren und durchzuführen und Prüfungsnachweise zu erlangen, die eine hinreichende und angemessene Grundlage für unser Urteil sind. Das Risiko, dass eine wesentliche Fehldarstellung nicht erkannt wird, wenn diese beabsichtigt ist, ist größer als bei einer unbeabsichtigten Fehldarstellung, da eine beabsichtigte Fehlerdarstellung auch Absprachen, Fälschungen, ein Verschweigen, die Verdrehung von Tatsachen oder das Übergehen der internen Kontrolle beinhalten kann.
- Zu einem Verständnis des internen Kontrollsystems zu gelangen, soweit es für die Prüfung von Bedeutung ist, um unter Berücksichtigung der Rahmenbedingungen geeignete Prüfungsverfahren festzulegen, nicht jedoch, um ein Urteil über die Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Einzuschätzen, ob die angewandten Grundsätze der Rechnungslegung geeignet und Schätzungen und die entsprechenden Angaben des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft angemessen sind.
- Schlussfolgerung zu ziehen, ob die Annahme der Fortführung der Geschäftstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als Grundlage der Rechnungslegung angemessen ist, und aufgrund der erhaltenen Prüfungsnachweise zu erkennen, ob eine erhebliche Unsicherheit hinsichtlich Ereignissen oder Umständen besteht, die Grund zu berechtigten Zweifeln an der Fortführung des Fonds oder seiner Subfonds geben. Kommen wir zu dem Schluss, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, müssen wir in unserem Prüfbericht auf die diesbezüglichen Offenlegungen im Jahresabschluss hinweisen oder, wenn diese Offenlegungen nicht angemessen sind, unser Prüfungsurteil ändern. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Prüfberichts erlangt haben;
- Die Gesamtdarstellung, die Struktur und den Inhalt des Jahresabschlusses, einschliesslich der Offenlegungen, einzuschätzen und zu prüfen, ob die zugrundeliegenden Transaktionen und Ereignisse im Jahresabschluss so dargestellt sind, dass ein getreues Bild gegeben wird.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, den 10. Juli 2024

Sandra Paulis

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

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

Wertpapierbestand zum Marktwert	3.168.063.489,14
Bareinlagen bei Banken und Brokern	38.535.179,99
Forderungen aus Erträgen	6.448.870,31
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	206.943,60
	3.213.254.483,04

Passiva

Rückstellungen für Aufwendungen	3.833.946,41
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	20.457.821,66
	24.291.768,07

Nettovermögen	3.188.962.714,97
----------------------	-------------------------

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	3.613.914.085,28
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	12.043.626,93
Dividenden (Netto)	13.760.713,48
Bankzinsen	885.309,59
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	78.358,32
Andere Erträge	2.169.885,43
	28.937.893,75
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	43.200.003,43
Depotbank- und Depotgebühr	2.030.226,94
Zentralverwaltungsvergütung	1.948.946,75
Druck- und Veröffentlichungskosten	69.053,59
Zinsen und Bankspesen	1.807,43
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	953.821,35
"Taxe d'abonnement"	815.709,52
	49.019.569,01
Nettoerträge (-verluste)	-20.081.675,26
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	47.899.834,81
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.166.184,86
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	3.501.953,79
	50.235.603,74
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	30.153.928,48
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	240.475.909,91
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-25.870.512,42
	214.605.397,49
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	244.759.325,97
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	106.429.075,62
Rücknahmen	-748.462.932,92
	-642.033.857,30
Währungsdifferenz	-27.676.838,98
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	3.188.962.714,97

Allgemeines

CS Investment Funds 12 (der „Fonds“) ist ein luxemburgischer Investmentfonds mit Subfonds („Umbrellafonds“). Der Fonds ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes vom 17.12.2010 in seiner geänderten Fassung in Luxemburg registriert.

Zum 31.03.2024 hatte der Fonds neun Subfonds aufgelegt.

Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

a) Darstellung des Abschlusses

Der Abschluss wurde gemäß den in Luxemburg für Organismen für gemeinsame Anlagen geltenden Bestimmungen nach der im Abschnitt „Ereignisse nach dem Bilanzstichtag“ erwähnten Verschmelzung aller Subfonds auf der Grundlage der Nicht-Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt.

b) Berechnung des Nettoinventarwerts des jeweiligen Subfonds

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

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

Der Anlageverwalter muss Transaktionen ausführen, um die gewünschte Allokation nach Zeichnungen oder Rücknahmen aufrechtzuerhalten. Hierdurch können zusätzliche Kosten für den Subfonds und die 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 wird regelmäßig überprüft, ob der angewendete Swing-Faktor angemessen ist.

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

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

Zum 31.03.2024 wurde kein Swing-Pricing angewendet.

c) Bewertung des Wertpapierbestands des jeweiligen Subfonds

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

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

Im Fall von Wertpapieren, die nur in geringem Masse an einer Börse gehandelt werden, die jedoch unter Wertpapierhändlern an einem Sekundärmarkt mit geregeltem Handel gehandelt werden (mit dem Effekt, dass der Kurs die Marktbedingungen widerspiegelt), kann sich die Bewertung auf diesen Sekundärmarkt stützen.

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

Wertpapiere, die nicht an einer Börse notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zum letzten vorliegenden 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 des voraussichtlich möglichen Verkaufspreises, dessen Wert mit der gebührenden Sorgfalt und nach bestem Wissen veranschlagt wird.

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

d) Guthaben bei Banken und Maklern

Guthaben bei Banken und Maklern umfassen Barbestände, Nachschussforderungen und Sichteinlagen bei Banken sowie 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 Änderungen der 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 Terminwechselkursen bewertet, und die daraus resultierenden Änderungen der 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“ unter „Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften“ verbucht.

j) Zuordnung der Aufwendungen

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

k) 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. Der Ertrag aus der Wertpapierleihe weist den Bruttoertrag aus der Wertpapierleihe abzüglich der direkten und indirekten Kosten aus, die von der Gegenpartei, die als Wertpapierleihe-Principal fungiert, erhoben werden.

I) Buchung von Erträgen

Dividendenerträge werden zum Ex-Datum abzüglich einer etwaigen Quellensteuer verbucht. Die Zinserträge werden nach Abzug der Quellensteuer zeitanteilig abgegrenzt.

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.

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.

"Taxe d'abonnement"

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

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

Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER)

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

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

Die TER wird nach der AMAS-Richtlinie berechnet.

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

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

Diese TER entspricht der Summe der anteilmäßigen TER der einzelnen Zielfonds, einschließlich einer etwaigen an die Wertentwicklung gebundenen Vergütung, gewichtet nach deren Anteil am Nettovermögen des Dachfonds am Bilanzstichtag, und der TER des Dachfonds, abzüglich der während des Geschäftsjahres vereinnahmten Retrozessionen von Zielfonds.

Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

Die Aufstellung aller während des Berichtsjahres 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.

Wechselkurse

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

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

Fondsperformance

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

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

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

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

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

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

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

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) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	2.650.657,00	2.788.243,77
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	17.072.479,00	17.958.654,48
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	8.004.367,00	8.419.847,01
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	202.535,00	213.047,92
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	1.328.246,00	1.397.190,82
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	843.828,00	887.628,03
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	4.911.149,00	5.166.070,38
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	15.969.268,00	16.798.179,48
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	11.385.443,00	11.976.423,40

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 Börsen innerhalb der OECD kotiert sind, unter der Voraussetzung, dass die Anteile in einem liquiden Hauptindex enthalten sind.

Bei der Bestimmung des Marktwerts der Sicherheiten werden angemessene "Haircuts" angewendet, die an die Volatilität der Art der Sicherheit angepasst sind.

Die Erlöse, die in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" unter "Erträge aus Wertpapierleihe" ausgewiesen sind, sind die vom Wertpapierleihe-Principal erhaltenen Nettobeträge. Alle direkten und indirekten betrieblichen Kosten und Gebühren werden aus seinen Gebühren getragen und umfassen das vom Principal getragene Haftungsrisiko.

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

Subfonds	Währung	Bruttobetrag Wertpapierleihe	Aufwendungen und Provisionen von der Gegenpartei der Wertpapierleihgeschäfte	Nettobetrag des Ertrags aus Wertpapierleihe
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	8.235,11	1.750,65	6.484,46
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	18.067,62	3.817,43	14.250,19
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	9.968,07	2.040,91	7.927,16
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	993,84	208,70	785,14
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	3.276,71	713,66	2.563,05
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	1.102,21	228,46	873,75
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	28.153,51	5.963,70	22.189,81
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	20.349,08	4.364,61	15.984,47
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	12.500,21	2.533,41	9.966,80

Transaktionskosten

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

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

Subfonds	Währung	Transaktionskosten
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	47.576,19
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	49.583,77
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	42.614,99
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	24.108,50
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	17.958,03
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	27.406,50
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	21.643,84
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	34.392,53
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	48.739,39

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.

Gesamtengagement

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

Derivative Finanzinstrumente

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

Je nach Art der gehaltenen Derivate können Sicherheiten von verschiedenen Gegenparteien entgegengenommen werden, um das Gegenparteirisiko zu mindern. Für andere Arten von Derivaten können Margenkonto genutzt werden.

Per 31.03.2024 hatten die Fonds keine Sicherheiten angenommen, um das Gegenparteirisiko zu mindern.

Krieg in der Ukraine

Als Reaktion auf den seit Ende Februar 2022 herrschenden Krieg in der Ukraine haben die USA, die EU, das Vereinigte Königreich, die Schweiz und andere Länder

weltweit strenge Sanktionen gegen das russische Finanzsystem sowie gegen russische Regierungsbeamte und Wirtschaftsführer verhängt. Die Sanktionen umfassen Beschränkungen für den Zugang russischer Banken zum Finanznachrichtendienst SWIFT sowie Einschränkungen in Bezug auf Transaktionen mit der russischen Zentralbank. Die russische Regierung hat ebenfalls bestimmte Gegenmassnahmen verhängt, zu denen Beschränkungen in Bezug auf Fremdwährungskonten und Wertpapiergeschäfte gehören.

Die Gesellschaft prüft laufend die Auswirkungen der bereits verhängten Sanktionen sowie möglicher künftiger Verschärfungen auf ihr Geschäft.

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

Der neue Verkaufsprospekt trat im Mai 2023 in Kraft.

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

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Die Subfonds des CS Investment Funds 12 wurden mit gleichwertigen Risikoprofilen des UBS (Lux) Strategy Fund - Sustainable verschmolzen.

Infolge dieser Verschmelzung haben die Anteilhaber des CS Investment Funds 12 Anteile am UBS (Lux) Strategy Fund - Sustainable erhalten.

Am 21.05.2024: Die folgenden Subfonds wurden verschmolzen:

Verschmelzende Fonds	Zielfonds
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (EUR)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	UBS (Lux) Strategy Fund - Growth Sustainable (EUR)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	UBS (Lux) Strategy Fund - Growth Sustainable (CHF)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	UBS (Lux) Strategy Fund - Growth Sustainable (USD)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (EUR)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (USD)

Am 31.05.2024: Die folgenden Subfonds wurden verschmolzen:

Verschmelzende Fonds	Zielfonds
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (CHF)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (USD)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (CHF)

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD

Der Berichtszeitraum vom 1. April 2023 bis 31. März 2024 war geprägt von Befürchtungen, dass die Volkswirtschaften aufgrund der drastischen Zinserhöhungen der wichtigsten Zentralbanken in ein rezessives Umfeld abgleiten könnten. Weitere Themen, die den Berichtszeitraum prägten, waren der anhaltende Krieg in der Ukraine sowie die weltweiten wirtschaftlichen und politischen Spannungen.

In den wichtigsten Wirtschaftsräumen verlangsamten sich die Wachstumsraten des Bruttoinlandsprodukts gegenüber 2022. Die europäischen Volkswirtschaften verzeichneten eine Verlangsamung der Wachstumsraten, während sich die USA bemerkenswert gut hielten und die asiatischen Volkswirtschaften recht gut abschnitten. Die Inflationsraten gingen weltweit deutlich zurück. Die Inflation scheint jedoch immer noch zu hoch zu sein, so dass die Zentralbanken diese Entwicklung weiterhin genau beobachten werden. Die USA verzeichneten ein starkes Beschäftigungswachstum, aber auch in der Eurozone war die Arbeitslosigkeit rückläufig. Die Unternehmensgewinne entwickelten sich insgesamt positiv, was auf einen starken Gewinnanstieg im Technologie- und Finanzsektor zurückzuführen war.

Die Renditen am Markt für langfristige Anleihen stiegen im Berichtszeitraum leicht an, insbesondere in Japan, das sich im März 2024 als letztes Land von seiner Nullzinspolitik abkehrte. In den meisten Ländern hat sich die Renditekurve umgekehrt (d. h. die kurzfristigen Zinsen sind höher als die langfristigen Zinsen). Dieses Phänomen deutet in der Regel auf ein schwächeres zukünftiges Wachstum hin.

Die Aktienmärkte entwickelten sich positiv, getragen von hohen Gewinnen insbesondere im Technologie- und Bankensektor. Der japanische Aktienmarkt erreichte nach seinem letzten Höchststand im Jahr 1989 einen neuen Rekordstand.

Auch die Anlageklasse der börsennotierten Immobilien verzeichnete einen Aufwärtstrend. Rohstoffe verzeichneten negative Renditen. Gegen Ende des Berichtszeitraums wurde die Performance jedoch durch den Anstieg der Ölpreise angekurbelt.

An den Devisenmärkten war zunächst bis September eine Abschwächung des USD und eine Stärkung des EUR zu beobachten, die sich bis März 2023 aufgrund der Widerstandsfähigkeit der US-Wirtschaft und der Neubewertung der für 2024 erwarteten Zinssenkungen umkehrte.

Anlagepolitik

Die Subfonds erzielten eine positive Performance.

Während des Berichtsjahres schätzten wir Aktien neutral und Anleihen positiv ein. Grund dafür war die Überzeugung, dass die Renditen von Anleihen attraktiv, die Bewertungen von Aktien jedoch überhöht waren. Rohstoffe und börsennotierte globale Immobilienwerte bewerteten wir im Berichtszeitraum neutral.

Informationen über die durch die 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
B - Thesaurierend	EUR	951124	LU0091100973	1,50%	1,87%
IB - Thesaurierend	EUR	1057476	LU0108835637	0,60%	0,98%
UB - Thesaurierend	EUR	26362612	LU1144411045	1,25%	1,62%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	EUR	4,69%	/	9,17%	-14,20%	10,99%
IB - Thesaurierend	EUR	4,93%	/	10,16%	-13,43%	11,99%
UB - Thesaurierend	EUR	4,76%	/	9,45%	-13,99%	11,26%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
<i>Gegenpartei</i>					
CAD	40.000	EUR	-27.489	10.05.2024	-154,28
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	750.000	EUR	-876.103	10.05.2024	-222,02
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	52.087.402	USD	-56.280.000	10.05.2024	69.710,31
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					69.334,01

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	289.827.944,60
Bareinlagen bei Banken und Brokern	2.508.784,32
Forderungen aus Erträgen	578.499,07
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	69.334,01
	292.984.562,00
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	362.379,15
	362.379,15
Nettovermögen	292.622.182,85

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	EUR	292.622.182,85	333.249.504,46	427.772.671,03
Nettoinventarwert pro Aktie				
B - Thesaurierend	EUR	209,68	189,95	203,82
IB - Thesaurierend	EUR	1.542,07	1.384,58	1.472,35
UB - Thesaurierend	EUR	126,98	114,75	122,82

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
B - Thesaurierend	EUR	1.054.599,704	1.274.643,731	22.755,266	242.799,293
IB - Thesaurierend	EUR	13.018,159	20.406,489	11,032	7.399,362
UB - Thesaurierend	EUR	404.949,654	543.157,623	13.600,442	151.808,411

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	333.249.504,46
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	911.750,83
Dividenden (Netto)	1.392.353,90
Bankzinsen	98.130,56
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	6.484,46
Andere Erträge	242.809,86
	2.651.529,61
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	4.177.884,01
Depotbank- und Depotgebühr	188.947,30
Zentralverwaltungsvergütung	181.351,96
Druck- und Veröffentlichungskosten	5.560,29
Zinsen und Bankspesen	52,08
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	76.236,87
"Taxe d'abonnement"	67.909,78
	4.697.942,29
Nettoerträge (-verluste)	-2.046.412,68
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	8.803.375,79
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.282.587,50
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	178.453,87
	7.699.242,16
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	5.652.829,48
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	23.925.802,46
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-562.139,36
	23.363.663,10
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	29.016.492,58
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	6.033.022,70
Rücknahmen	-75.676.836,89
	-69.643.814,19
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	292.622.182,85

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	54,55
Vereinigte Staaten	14,12
Irland	9,52
Frankreich	4,69
Niederlande	4,05
Deutschland	3,47
Italien	2,05
Spanien	1,45
Supranational	1,07
Schweiz	0,94
Finnland	0,88
Belgien	0,44
Polen	0,33
Portugal	0,33
Österreich	0,29
Mexiko	0,25
Niederländische Antillen	0,24
Norwegen	0,15
Australien	0,11
Kanada	0,11
Total	99,05

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	63,08
Länder und Zentralregierungen	5,94
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	4,50
Banken und andere Kreditinstitute	4,06
Energie- und Wasserversorgung	2,16
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	2,06
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	1,90
Elektronik und Halbleiter	1,59
Versicherungsgesellschaften	1,42
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	1,14
Elektrische Geräte und Komponenten	1,11
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,10
Supranationale Organisationen	1,07
Petroleum	0,96
Telekommunikation	0,85
Fahrzeuge	0,85
Baustoffe und Bauindustrie	0,69
Einzelhandel und Warenhäuser	0,58
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,58
Verkehr und Transport	0,55
Computerhardware und Netzwerk	0,51
Immobilien	0,40
Verschiedene Konsumgüter	0,40
Grafikverlags- und Druckmedien	0,38
Chemie	0,23
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,21
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,16
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,12
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,11
Gummi und Reifen	0,11
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,11
Uhrenindustrie, Schmuck	0,05
Gesundheits- und Sozialdienste	0,03
Diverse Dienstleistungen	0,01
Verpackungsindustrie	0,00
Total	99,05

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	3.600	155.028,53	0,05
EUR ADIDAS REG	2.220	459.540,00	0,16
USD ADOBE	809	377.982,78	0,13
CHF ALCON INC	1.080	82.980,42	0,03
USD ALPHABET A	10.748	1.502.033,00	0,51
USD ALPHABET C	9.471	1.335.235,61	0,46
EUR AMADEUS IT GROUP A	6.180	367.339,20	0,13
USD AMERICAN EXPRESS	2.351	495.647,40	0,17
EUR ASML HOLDING	4.600	4.104.120,00	1,40
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	14.300	335.478,00	0,11
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	3.387	783.212,39	0,27
EUR AXA	25.500	887.782,50	0,30
CHF BALOISE-HOLDING REG	84	12.201,70	0,00
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	55	5.925,47	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	8	10.765,36	0,00
CHF BKW	42	5.975,64	0,00
EUR BMW	3.990	426.770,40	0,15
EUR BNP PARIBAS A	13.600	895.696,00	0,31
USD CATERPILLAR	3.521	1.194.829,66	0,41
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	1.050	148.419,43	0,05
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	9.220	327.494,40	0,11
USD COCA-COLA	13.627	771.944,31	0,26
USD DANAHER	1.996	461.519,56	0,16
EUR DANONE	9.430	564.762,70	0,19
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	7.610	312.314,40	0,11
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	2.680	508.262,00	0,17
EUR DEUTSCHE POST REG	15.700	626.665,50	0,21
CHF DUFFY	181	5.963,22	0,00
USD ELI LILLY & CO	2.581	1.859.180,33	0,64
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	10	7.113,85	0,00
EUR ENEL	106.000	648.614,00	0,22
CHF GEBERIT	69	37.807,25	0,01
CHF GVAUDAN REG	19	78.441,53	0,03
CHF HELVETIA HOLDING LTD	62	7.922,49	0,00
EUR HENKEL PREF	2.490	185.505,00	0,06
EUR HERMES INTERNATIONAL	394	932.234,00	0,32
USD HOME DEPOT	2.744	974.628,15	0,33
EUR IBERDROLA	80.260	922.588,70	0,32
USD IBM	1.497	264.691,78	0,09
EUR ING GROUP	46.900	715.037,40	0,24
USD INTEL	7.331	299.824,32	0,10
USD INTUIT	497	299.120,37	0,10
USD JOHNSON & JOHNSON	6.266	917.794,94	0,31
CHF JULIUS BAER GRUPPE	380	20.344,80	0,01
EUR KERING	1.020	373.677,00	0,13
EUR KERRY GROUP A	2.330	185.095,20	0,06
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	14.100	390.852,00	0,13
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	122	31.479,83	0,01
CHF LAFARGEHOLCIM REG	990	83.108,10	0,03
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	22.184,53	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	429	35.616,59	0,01
CHF LONZA REG	162	89.963,92	0,03
EUR L'OREAL	3.280	1.438.772,00	0,49
EUR LVMH	3.450	2.876.265,00	0,98
USD MASTERCARD	3.147	1.403.241,47	0,48
USD MCDONALD'S	1.833	478.531,81	0,16
EUR MERCK	1.390	227.404,00	0,08
USD MERCK & CO	6.612	807.827,22	0,28
USD MICROSOFT	12.955	5.046.692,22	1,72
EUR MUECHENER RUECKVER REG RESTRICTED	1.920	868.416,00	0,30
EUR NESTE OYJ	5.620	141.062,00	0,05
CHF NESTLE REG	4.990	491.177,08	0,17
CHF NOVARTIS REG	3.830	344.001,13	0,12
USD NVIDIA	4.510	3.773.199,63	1,29
EUR ORANGE	26.800	291.798,40	0,10
CHF PARTNERS GROUP	38	50.315,09	0,02
USD PROCTER & GAMBLE	6.535	981.762,73	0,34
USD PROLOGIS	6.237	752.020,50	0,26
EUR REPSOL	14.100	217.704,00	0,07
CHF ROCHE HOLDING	57	14.239,01	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	1.260	297.529,68	0,10
USD S&P GLOBAL	1.209	476.267,64	0,16
USD SALESFORCE.COM	1.593	444.240,50	0,15
CHF SANDOZ GROUP LTD	665	18.601,54	0,01
USD SCHLUMBERGER	13.819	701.314,25	0,24
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	9.450	1.981.192,50	0,68
USD SEMPRA ENERGY	4.529	301.220,44	0,10
CHF SGS LTD	336	30.223,59	0,01
USD SHERWIN-WILLIAMS	2.889	929.107,75	0,32
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	627	12.891,29	0,00
CHF SIKA LTD	287	79.247,70	0,03
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	10.400	258.024,00	0,09
CHF SONOVA HOLDING REG	110	29.525,57	0,01
EUR STMICROELECTRONICS	7.840	313.090,40	0,11
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	224	33.159,60	0,01
CHF SWISS LIFE REG	54	35.095,14	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	145	12.677,72	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	603	71.876,48	0,02
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	52	29.476,02	0,01
EUR SYMRISE	4.600	510.370,00	0,17
USD TESLA MOTORS	7.274	1.183.978,20	0,40
CHF TEXAS INSTRUMENTS	1.621	261.476,31	0,09
CHF THE SWATCH GROUP	45	9.686,97	0,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettvermö- gens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettvermö- gens
EUR TOTAL ENERGIES	27.600	1.751.772,00	0,60	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD	802	145.845,19	0,05
CHF UBS GROUP	6.100	173.954,25	0,06	ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			
USD UNION PACIFIC	4.241	965.730,68	0,33	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	264	228.317,69	0,08
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	13.100	365.220,00	0,12	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
EUR UPM-KYMMENE	20.200	623.574,00	0,21	LOCAL -QBX USD- USD			
CHF VAT GROUP	56	26.901,88	0,01	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	6.425	5.828.771,04	1,99
USD VERIZON COMMUNICATIONS	9.222	358.291,78	0,12	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
USD VISA A	5.460	1.410.904,44	0,48	USD -QBX USD- USD			
EUR VONOVIA REG	14.300	391.820,00	0,13	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	18.691	18.434.691,01	6,30
EUR WOLTERS KLUWER	4.290	622.908,00	0,21	(LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -			
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	291	145.477,56	0,05	QBX- USD			
Total Aktien		61.610.770,83	21,05	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	3.981	5.933.083,35	2,03
Anleihen				(LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR			
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	2.000.000	1.889.780,00	0,65	ACC- EUR			
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	1.000.000	882.592,59	0,30	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	6.598	7.845.339,22	2,68
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED)	2.000.000	1.784.540,00	0,61	(LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY			
2.124%/19-01.10.2030				GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	2.115	3.240.221,07	1,11
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	900.000	855.909,00	0,29	(LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP			
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	1.500.000	1.303.888,89	0,45	ACC- GBP			
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	1.000.000	926.360,00	0,32	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	3.191	3.675.145,61	1,26
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	1.450.000	1.278.798,50	0,44	(LUX)EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX			
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	500.000	435.310,00	0,15	USD ACC- USD			
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	1.000.000	886.220,00	0,30	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	4.352	3.843.636,37	1,31
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-	500.000	327.800,21	0,11	(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX			
18.06.2027				CAD ACC- CAD			
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-	1.000.000	726.018,52	0,25	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX)	2.071	3.163.299,09	1,08
01.09.2032				GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND			
EUR DAIMLER AG 0.75%/20-10.09.2030	1.000.000	870.520,00	0,30	EB USD			
EUR DEUTSCHLAND 2.3%/23-150233	500.000	502.010,00	0,17	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT	11.352	12.249.333,56	4,19
EUR E.ON SE 0.875%/20-200831	1.500.000	1.259.400,00	0,43	SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -			
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	1.000.000	975.360,00	0,33	EB- USD			
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-	250.000	224.326,39	0,08	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	1.611	2.967.089,08	1,01
13.02.2025				SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -			
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-	2.000.000	2.004.780,00	0,69	EB- USD			
280728				USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	283	207.082,63	0,07
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-	500.000	451.768,52	0,15	SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP			
13.06.2025				USD- USD			
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	2.000.000	1.816.360,00	0,62	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	2.286	2.703.957,00	0,92
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	1.000.000	829.250,00	0,28	SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY			
EUR GERMANY 0.5%/15-150225	500.000	487.875,00	0,17	FUND -EBP USD ACC- USD			
EUR IBERDROLA FINANZAS 3.375%/22-221132	500.000	499.830,00	0,17	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	365	470.010,43	0,16
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	2.000.000	1.868.700,00	0,64	SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY			
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	1.500.000	1.346.310,00	0,46	FUND -EB- CHF			
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	500.000	440.379,63	0,15	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	2.555	3.109.553,29	1,06
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	2.000.000	1.849.520,00	0,63	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE			
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	1.000.000	811.296,30	0,28	BOND FUND -EB- USD			
EUR KFW 2.75%/23-140233	2.000.000	2.010.840,00	0,69	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	4.645	5.618.944,68	1,92
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-	500.000	450.731,48	0,15	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE			
11.02.2025				INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD			
EUR NEDER WATERSCHAPS BANK S. -1414- 1%/15-	1.000.000	968.050,00	0,33	USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT	8.040	7.507.435,48	2,57
03.09.2025				SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES			
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	1.600.000	1.521.968,00	0,52	FUND -EA- USD			
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	500.000	484.845,00	0,17	USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	71.326	7.387.524,41	2,52
USD OBRIGACIOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	500.000	492.270,00	0,17	USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	13.976	2.232.018,96	0,76
USD PEPSICO INC 3.9%/22-180732	500.000	438.481,48	0,15	Total Fondsteile (Open-End)		184.584.244,86	63,08
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	1.000.000	868.730,00	0,30	Total Investmentfonds		184.584.244,86	63,08
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	1.000.000	957.600,00	0,33	Total des Wertpapierbestandes		289.827.944,60	99,05
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-	1.000.000	801.518,52	0,27	Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.508.784,32	0,86
13.02.2030				Andere Nettvermögenswerte		285.453,93	0,09
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-	150.000	93.964,18	0,03	Fondsvermögen		292.622.182,85	100,00
17.11.2026							
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	400.000	221.962,61	0,08				
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	1.000.000	901.294,85	0,31				
USD US 4.5%/06-15.02.2036	500.000	481.264,47	0,16				
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	500.000	454.589,84	0,16				
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	800.000	689.062,50	0,24				
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	1.000.000	874.421,30	0,30				
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	1.000.000	847.294,56	0,29				
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	1.000.000	741.608,80	0,25				
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-	1.500.000	1.329.583,33	0,45				
08.02.2029							
USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-	500.000	467.944,44	0,16				
16.03.2037							
Total Anleihen		43.632.928,91	14,91				
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt							
gehandelte Wertpapiere		105.243.699,74	35,97				
Investmentfonds							
Fondsteile (Open-End)							
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION	9.265	7.054.268,06	2,41				
FUND -EB- USD							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND	253	675.232,93	0,23				
PLUS EQUITY FUND EB EUR							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY	47.443	11.248.735,30	3,84				
GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR							
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD	4.348	5.878.966,06	2,01				
BOND FUND -MB- USD							
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND	1.359	3.398.910,15	1,16				
EB USD							
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND	2.173	5.277.432,31	1,80				
B USD							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE	271.806	38.199.615,24	13,05				
BOND FUND -EB- EUR							
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG	82.397	16.059.785,65	5,49				
LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP							

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	CHF	672328	LU0078040838	1,50%	1,85%
IB - Thesaurierend	CHF	1057438	LU0108822734	0,60%	0,95%
UB - Thesaurierend	CHF	26362645	LU1144411128	1,25%	1,60%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	CHF	6,17%	/	3,63%	-16,12%	8,42%
IB - Thesaurierend	CHF	6,41%	/	4,57%	-15,36%	9,40%
UB - Thesaurierend	CHF	6,23%	/	3,89%	-15,91%	8,68%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In CHF)
<i>Gegenpartei</i>					
CHF	945.433	CAD	-1.480.000	10.05.2024	-35.631,14
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	146.034.456	USD	-169.770.000	10.05.2024	-6.179.637,75
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	2.450.000	CHF	-2.660.345	10.05.2024	114.647,75
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.250.000	CHF	-1.186.279	10.05.2024	26.055,00
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	44.999.322	EUR	-48.410.000	10.05.2024	-1.957.741,89
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-8.032.308,03

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	832.630.393,17
Bareinlagen bei Banken und Brokern	10.865.366,40
Forderungen aus Erträgen	1.589.204,51
	845.084.964,08
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	1.044.673,03
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	8.032.308,03
	9.076.981,06
Nettovermögen	836.007.983,02

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	CHF	836.007.983,02	900.916.530,68	1.076.494.069,83
Nettoinventarwert pro Aktie				
B - Thesaurierend	CHF	215,05	200,68	222,12
IB - Thesaurierend	CHF	1.500,18	1.387,50	1.521,94
UB - Thesaurierend	CHF	119,64	111,37	122,96

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
B - Thesaurierend	CHF	2.527.898,885	2.905.610,851	71.006,115	448.718,081
IB - Thesaurierend	CHF	9.932,590	10.526,106	0,000	593,516
UB - Thesaurierend	CHF	2.319.309,891	2.722.451,844	71.806,458	474.948,411

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	900.916.530,68
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.425.747,00
Dividenden (Netto)	4.267.950,05
Bankzinsen	136.833,80
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14.250,19
Andere Erträge	538.348,14
	7.383.129,18
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	11.684.954,13
Depotbank- und Depotgebühr	521.333,47
Zentralverwaltungsvergütung	500.397,40
Druck- und Veröffentlichungskosten	8.535,20
Zinsen und Bankspesen	25,27
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	156.604,28
"Taxe d'abonnement"	217.375,73
	13.089.225,48
Nettoerträge (-verluste)	-5.706.096,30
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	10.773.737,74
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	4.123.549,03
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	1.344.524,82
	16.241.811,59
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	10.535.715,29
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	56.274.011,40
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-9.533.697,44
	46.740.313,96
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	57.276.029,25
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	22.445.599,64
Rücknahmen	-144.630.176,55
	-122.184.576,91
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	836.007.983,02

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	48,18
Schweiz	15,74
Vereinigte Staaten	12,43
Irland	8,47
Supranational	2,28
Niederlande	2,08
Deutschland	2,01
Kanada	1,96
Frankreich	1,30
Norwegen	1,03
Österreich	0,73
Finnland	0,64
Schweden	0,48
Spanien	0,40
Australien	0,33
Neuseeland	0,29
Italien	0,28
Vereinigte Arabische Emirate	0,23
Niederländische Antillen	0,20
Chile	0,17
Belgien	0,16
Mexiko	0,08
Polen	0,06
Portugal	0,06
Total	99,60

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	56,16
Banken und andere Kreditinstitute	9,38
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	5,51
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	3,50
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	3,46
Supranationale Organisationen	2,84
Länder und Zentralregionen	2,83
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	1,94
Versicherungsgesellschaften	1,70
Kantone, Bundesländer, Provinzen	1,42
Elektrische Geräte und Komponenten	1,31
Baustoffe und Bauindustrie	1,22
Chemie	1,01
Verkehr und Transport	0,91
Uhrenindustrie, Schmuck	0,90
Telekommunikation	0,78
Computerhardware und Netzwerk	0,67
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,62
Gesundheits- und Sozialdienste	0,47
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,45
Energie- und Wasserversorgung	0,35
Fahrzeuge	0,34
Immobilien	0,29
Verschiedene Konsumgüter	0,28
Elektronik und Halbleiter	0,23
Petroleum	0,23
Diverse Dienstleistungen	0,17
Grafikverlags- und Druckmedien	0,15
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,13
Städte und Gemeinden	0,12
Verpackungsindustrie	0,07
Einzelhandel und Warenhäuser	0,07
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,06
Gummi und Reifen	0,01
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,01
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,01
Total	99,60

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	176.164	7.379.509,96	0,88
EUR ADIDAS REG	353	71.079,82	0,01
USD ADOBE	1.944	883.529,37	0,11
CHF ALCON INC	53.045	3.964.583,30	0,47
USD ALPHABET A	25.798	3.507.026,88	0,42
USD ALPHABET C	22.718	3.115.540,53	0,37
EUR AMADEUS IT GROUP A	982	56.779,50	0,01
USD AMERICAN EXPRESS	5.641	1.156.851,31	0,14
EUR ASML HOLDING	730	633.557,91	0,08
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	2.280	53.031,23	0,01
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	8.134	1.822.657,33	0,22
EUR AXA	4.050	137.158,48	0,02
CHF BALOISE-HOLDING REG	4.129	583.427,70	0,07
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	2.701	283.064,80	0,03
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	359	469.931,00	0,06
CHF BKW	1.947	269.464,80	0,03
EUR BMW	634	65.964,75	0,01
EUR BNP PARIBAS A	2.160	138.381,08	0,02
USD CATERPILLAR	8.471	2.795.781,25	0,33
CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI	10	1.088.000,00	0,13
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	51.381	7.064.887,50	0,85
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	1.460	50.446,04	0,01
USD COCA-COLA	32.825	1.808.804,76	0,22
USD DANAHER	4.803	1.080.297,56	0,13
EUR DANONE	1.500	87.387,00	0,01
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	1.210	48.305,21	0,01
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	426	78.589,35	0,01
EUR DEUTSCHE POST REG	2.500	97.068,29	0,01
CHF DUFFY	8.838	331.690,14	0,04
USD ELI LILLY & CO	6.209	4.350.672,69	0,52
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	469	324.548,00	0,04
EUR ENEL	16.900	100.593,15	0,01
CHF GEBERIT	3.376	1.799.408,00	0,22
CHF GVAUDAN REG	933	3.748.928,00	0,45
CHF HELVETIA HOLDING LTD	3.054	379.612,20	0,05
EUR HENKEL PREF	396	28.698,07	0,00
EUR HERMES INTERNATIONAL	63	144.996,17	0,02
USD HOME DEPOT	6.594	2.278.269,13	0,27
EUR IBERDROLA	12.715	142.176,10	0,02
USD IBM	3.600	619.187,80	0,07
EUR ING GROUP	7.450	110.487,57	0,01
USD INTEL	17.616	700.829,19	0,08
USD INTUIT	1.193	698.443,51	0,08
USD JOHNSON & JOHNSON	15.017	2.139.634,99	0,26
CHF JULIUS BAER GRUPPE	18.595	968.427,60	0,12
EUR KERING	162	57.731,45	0,01
EUR KERRY GROUP A	371	28.669,12	0,00
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	2.250	60.670,42	0,01
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	5.970	1.498.470,00	0,18
CHF LAFARGEHOLCIM REG	48.446	3.956.100,36	0,47
CHF LINDT & SPRUENGLI	88	949.520,00	0,11
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	20.943	1.691.356,68	0,20
CHF LONZA REG	7.908	4.271.901,60	0,51
EUR L'OREAL	521	222.309,03	0,03
EUR LVMH	549	445.228,94	0,05
USD MASTERCARD	7.556	3.277.396,53	0,39
USD MCDONALD'S	4.399	1.117.129,56	0,13
EUR MERCK	221	35.170,36	0,00
USD MERCK & CO	15.883	1.887.641,06	0,23
USD MICROSOFT	31.093	11.782.386,60	1,41
EUR MUENCHENER RUECKVER REG RESTRICTED	306	134.632,30	0,02
EUR NESTE OYJ	893	21.803,51	0,00
CHF NESTLE REG	243.695	23.333.796,25	2,79
CHF NOVARTIS REG	187.909	16.417.609,33	1,96
USD NVIDIA	10.877	8.852.044,92	1,06
EUR ORANGE	4.260	45.118,95	0,01
CHF PARTNERS GROUP	1.859	2.394.392,00	0,29
USD PROCTER & GAMBLE	15.690	2.292.900,10	0,27
USD PROLOGIS	15.017	1.761.320,36	0,21
EUR REPSOL	2.230	33.492,95	0,00
CHF ROCHE HOLDING	2.798	679.914,00	0,08
CHF ROCHE HOLDING CERT	61.560	14.140.332,00	1,69
USD S&P GLOBAL	2.916	1.117.412,52	0,13
USD SALESFORCE.COM	3.840	1.041.681,23	0,12
CHF SANDOZ GROUP LTD	32.491	884.080,11	0,11
USD SCHLUMBERGER	33.114	1.634.740,91	0,20
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	1.500	305.905,56	0,04
USD SEMPRA ENERGY	10.877	703.707,98	0,08
CHF SGS LTD	16.442	1.438.675,00	0,17
USD SHERWIN-WILLIAMS	6.950	2.174.225,50	0,26
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	30.633	612.660,00	0,07
CHF SIKA LTD	13.996	3.759.325,60	0,45
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	1.650	39.820,98	0,00
CHF SONOVA HOLDING REG	5.372	1.402.629,20	0,17
EUR STMICROELECTRONICS	1.250	48.558,46	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	10.961	1.578.384,00	0,19
CHF SWISS LIFE REG	2.642	1.670.272,40	0,20
CHF SWISS PRIME SITE	7.066	600.963,30	0,07
CHF SWISS REINSURANCE	29.459	3.415.771,05	0,41
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	2.369	1.306.266,60	0,16
EUR SYMRISE	731	78.894,35	0,01
USD TESLA MOTORS	17.519	2.773.837,17	0,33
USD TEXAS INSTRUMENTS	3.889	610.222,91	0,07

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

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettvermö- gens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettvermö- gens
CHF THE SWATCH GROUP	2.084	438.483,60	0,05	CHF MANITOBA (PROVINCE OF) 0.25%/19-15.03.2029	2.000.000	1.904.000,00	0,23
EUR TOTAL ENERGIES	4.390	271.040,54	0,03	CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027	1.000.000	955.000,00	0,11
CHF UBS GROUP	298.502	8.280.445,48	0,99	CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG	4.000.000	3.750.000,00	0,45
USD UNION PACIFIC	10.203	2.260.043,93	0,27	0.25%/20-18.09.2028			
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	2.080	56.410,16	0,01	CHF MUENCHNR HYPOTKBNK SUB 4.2525%/23-07.06.33	1.000.000	1.062.000,00	0,13
EUR UPM-KYMMENE	3.200	96.092,14	0,01	CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	1.500.000	1.509.000,00	0,18
CHF VAT GROUP	2.741	1.280.869,30	0,15	EUR NEDER WATERSCHAPS BANK S. -1414- 1%/15-03.09.2025	500.000	470.835,32	0,06
USD VERIZON COMMUNICATIONS	22.140	836.740,10	0,10	EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	350.000	323.858,14	0,04
USD VISA A	13.091	3.290.629,76	0,39	CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK	4.500.000	4.261.500,00	0,51
EUR VONOVIA REG	2.270	60.503,10	0,01	0.2%/20-28.11.2028			
EUR WOLTERS KLUWER	681	96.186,69	0,01	CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK	1.500.000	1.481.400,00	0,18
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	14.288	6.948.254,40	0,83	0.25%/15-30.04.2025			
Total Aktien		210.164.480,43	25,14	EUR OBRIGACOE'S DO TESOURO 144A 1.95%/150629	250.000	235.816,49	0,03
Anleihen				EUR OBRIGACOE'S DO TESOURO 2.125%/18-171028	250.000	239.427,82	0,03
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	5.000.000	5.125.000,00	0,61	CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.05%/21-120533	2.000.000	1.782.000,00	0,21
CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025	2.000.000	1.962.000,00	0,23	USD PEPSCO INC 3.9%/22-180732	500.000	426.532,86	0,05
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	3.000.000	2.575.625,83	0,31	EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	1.000.000	845.057,11	0,10
EUR ASIAN DEVELOPMENT BANK 0%/19-24.10.2029	1.000.000	839.843,17	0,10	CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029	2.000.000	1.905.000,00	0,23
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED)	1.000.000	867.955,64	0,10	CHF PROVINCE OF QUEBEC 2.04%/23-090533	5.000.000	5.300.000,00	0,63
2.124%/19-01.10.2030				EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	500.000	465.752,70	0,06
CHF AUCLAND COUNCIL 1.66%/22-181027	1.000.000	1.012.000,00	0,12	USD ROYAL BANK OF CANADA S H 1.15%/21-140726	2.000.000	1.650.414,49	0,20
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	2.000.000	1.691.143,89	0,20	CHF SOCIETE NATIONALE SNCF 1.5825%/24-070239	2.000.000	2.038.000,00	0,24
CHF BANCO BILBAO SA 2.4075%/22-281125	1.000.000	1.013.500,00	0,12	CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 2.7%/23-200329	3.600.000	3.704.400,00	0,44
CHF BANCO DE CREDITO E 0.5994%/22-260427	1.500.000	1.435.500,00	0,17	CHF SWEDBANK AB 2.7725%/23-130628	2.000.000	2.070.000,00	0,25
CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	1.500.000	1.427.250,00	0,17	USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	2.000.000	1.559.354,28	0,19
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.1425%/21-251028	500.000	468.500,00	0,06	AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	1.000.000	609.357,70	0,07
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027	1.750.000	1.697.500,00	0,20	AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	2.250.000	1.214.516,97	0,15
CHF BAWAG P.S.K. 2.955%/22-291127	5.000.000	5.172.500,00	0,62	USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	3.500.000	3.068.570,99	0,37
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	500.000	428.948,70	0,05	USD US 4.5%/06-15.02.2036	3.000.000	2.808.900,07	0,34
EUR BELGIUM OLO S 81 0.84%/17-220627	1.000.000	916.476,41	0,11	USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	1.000.000	884.404,54	0,11
CHF BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028	1.000.000	937.000,00	0,11	USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	2.000.000	1.675.713,88	0,20
CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	1.000.000	979.500,00	0,12	USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	3.000.000	2.551.779,95	0,31
CHF BNG BANK 3.25%/07-290637	500.000	621.500,00	0,07	USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	3.000.000	2.472.617,36	0,30
CHF BNG BANK NV 1.7925%/23-240428	3.000.000	3.070.500,00	0,37	USD US TREASURY N/B S C-2032 2.875%/22-15053	1.000.000	818.224,61	0,10
CHF BNP PARIBAS SA S.19447 0.1475%/21-130727	1.000.000	952.500,00	0,11	USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	3.000.000	2.164.199,87	0,26
CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LB)	1.500.000	1.407.000,00	0,17	USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	4.000.000	3.448.939,17	0,41
11%/20-24.07.2028				USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037	1.000.000	910.385,92	0,11
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	250.000	211.723,90	0,03	Total Anleihen		152.961.267,90	18,30
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	250.000	215.517,63	0,03	Total börsennotierte / an einem geregelten Markt		363.125.748,33	43,44
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	300.000	275.444,86	0,03	gehandelte Wertpapiere			
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	1.500.000	956.602,95	0,11	Investmentfonds			
EUR BUENDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-150229	500.000	441.322,08	0,05	Fondsanteile (Open-End)			
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	1.000.000	962.500,00	0,12	USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION	27.062	20.043.227,87	2,40
0.05%/19-15.10.2026				FUND -EB- USD			
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	1.500.000	1.467.000,00	0,18	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND	354	921.105,85	0,11
0.125%/15-22.12.2025				PLUS EQUITY FUND EB EUR			
CHF CENTRAL AMER BANK 0.11%/21-151228	4.000.000	3.704.000,00	0,44	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY	58.536	13.500.685,97	1,61
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	1.000.000	706.234,51	0,08	GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR			
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	1.000.000	975.000,00	0,12	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD	12.856	16.910.827,96	2,02
CHF COOPERATIVE RABOBANK UA 0.25%/19-25.11.2027	2.600.000	2.467.400,00	0,30	BOND FUND -MB- USD			
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	1.000.000	1.040.500,00	0,12	USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND	3.461	8.417.716,52	1,01
CHF CORPORACION ANDINA 0.45%/22-240227	3.000.000	2.883.000,00	0,34	EB USD			
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026	2.000.000	1.951.000,00	0,23	USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND	6.916	16.338.762,84	1,95
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.1637%/21-280428	1.500.000	1.412.250,00	0,17	B USD			
CHF DEUTSCHE BAHN FIN 1.885%/23-130935	3.000.000	3.172.500,00	0,38	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE	188.500	25.769.888,72	3,08
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.5%/18-18.07.2028	2.000.000	1.937.000,00	0,23	BOND FUND -EB- EUR			
CHF DNB BANK ASA 2.685%/23-150628	2.000.000	2.045.000,00	0,24	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG	203.407	38.565.190,30	4,61
CHF EIB 1.46%/23-180733	600.000	618.900,00	0,07	LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			
CHF EIB 3.375%/07-151027	3.000.000	3.234.000,00	0,39	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD	26.354	4.661.927,43	0,56
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	1.500.000	1.309.280,97	0,16	ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	2.000.000	1.566.091,47	0,19	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	592	496.907,05	0,06
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-280728	1.750.000	1.706.381,03	0,20	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.000.000	878.915,65	0,11	LOCAL -QBX USD- USD			
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	2.000.000	1.684.841,91	0,20	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	21.544	19.010.842,57	2,27
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	370.000	327.719,28	0,04	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	1.500.000	1.325.148,14	0,16	USD -QBX USD- USD			
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	2.000.000	1.894.000,00	0,23	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	56.459	54.167.552,82	6,48
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	500.000	450.577,80	0,05	(LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -			
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	500.000	411.390,57	0,05	QBX- USD			
EUR GERMANY 0.25%/17-150227	1.000.000	911.982,31	0,11	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	6.590	9.553.773,17	1,14
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029	1.000.000	899.500,00	0,11	(LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR			
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	1.000.000	890.543,62	0,11	ACC- EUR			
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	1.500.000	1.363.333,44	0,16	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	17.554	20.303.772,99	2,43
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	1.500.000	1.309.623,05	0,16	(LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY			
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	1.500.000	1.285.137,85	0,15	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	5.278	7.865.655,02	0,94
EUR KFW 0.01%/19-05.05.2027	500.000	446.881,35	0,05	(LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP			
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	2.000.000	1.578.376,94	0,19	ACC- GBP			
EUR KFW 2.75%/23-140233	2.000.000	1.956.044,61	0,23	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	7.528	8.433.902,90	1,01
CHF KOMMUNALBANKEN 1.275%/22-221227	2.000.000	2.006.000,00	0,24	(LUX)EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX			
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	1.000.000	876.898,10	0,10	USD ACC- USD			
CHF KUNTARAHIOITUS OYJ 1.625%/23-160628	2.000.000	2.037.000,00	0,24	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV -	12.540	10.773.385,09	1,29
				CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX			
				CAD ACC- CAD			

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
USD	CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB-USD	6.010	8.929.679,45	1,07
USD	CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB-USD	39.098	41.038.914,05	4,91
CHF	CS INVESTMENT FUNDS 14 - CREDIT SUISSE (LUX) SWISS FRANC BOND FUND -EB-	409.461	49.184.455,32	5,88
USD	CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB-USD	4.122	7.384.894,11	0,88
USD	CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD-USD	674	479.753,74	0,06
USD	CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC-USD	4.972	5.720.788,79	0,68
CHF	CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB-CHF	5.956	7.460.545,16	0,89
USD	CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB-USD	8.172	9.674.681,94	1,16
USD	CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB-USD	12.748	15.000.727,85	1,79
USD	CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA-USD	23.483	21.329.376,94	2,55
USD	CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	210.238	21.181.831,82	2,53
USD	CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	41.093	6.383.870,60	0,76
Total Fondsanteile (Open-End)			469.504.644,84	56,16
Total Investmentfonds			469.504.644,84	56,16
Total des Wertpapierbestandes			832.630.393,17	99,60
Bareinlagen bei Banken und Brokern			10.865.366,40	1,30
Andere Passiva			-7.487.776,55	-0,90
Fondsvermögen			836.007.983,02	100,00

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	USD	672327	LU0078041133	1,50%	1,89%
EB - Thesaurierend	USD	28145643	LU1230136977	0,60%	0,97%
IB - Thesaurierend	USD	1057436	LU0108835801	0,60%	1,00%
UB - Thesaurierend	USD	26362734	LU1144411391	1,25%	1,64%
BH - Thesaurierend	JPY	36829019	LU1614284856	1,50%	1,98%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	USD	4,04%	/	12,26%	-16,59%	8,64%
EB - Thesaurierend	USD	4,27%	/	13,29%	-15,82%	9,64%
IB - Thesaurierend	USD	4,27%	/	13,27%	-15,84%	9,62%
UB - Thesaurierend	USD	4,10%	/	12,54%	-16,38%	8,91%
BH - Thesaurierend	JPY	2,64%	/	5,85%	-18,76%	8,16%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
JPY	1.895.132.300	USD	-12.865.380	09.04.2024	-320.556,81
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	1.766.823.900	USD	-11.722.349	23.04.2024	-1.896,77
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	118.818	CAD	-160.000	10.05.2024	519,09
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	650.000	USD	-820.442	10.05.2024	853,45
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	12.748.413	EUR	-11.800.000	10.05.2024	-18.410,38
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					

Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften

-339.491,42

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	300.122.691,70
Bareinlagen bei Banken und Brokern	2.584.545,37
Forderungen aus Erträgen	538.217,93
	303.245.455,00
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	363.550,93
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	339.491,42
	703.042,35
Nettovermögen	302.542.412,65

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	USD	302.542.412,65	319.750.930,31	428.069.419,28
Nettoinventarwert pro Aktie				
B - Thesaurierend	USD	348,38	311,29	339,12
EB - Thesaurierend	USD	1.495,38	1.324,03	1.429,19
IB - Thesaurierend	USD	1.625,06	1.439,13	1.553,75
UB - Thesaurierend	USD	143,33	127,75	138,82
BH - Thesaurierend	JPY	10.908,00	10.345,00	11.706,00

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
B - Thesaurierend	USD	503.704,283	567.898,613	73.378,558	137.572,888
EB - Thesaurierend	USD	8.104,482	9.604,959	759,356	2.259,833
IB - Thesaurierend	USD	22.984,065	28.257,318	3.890,924	9.164,177
UB - Thesaurierend	USD	370.680,527	422.353,542	14.349,362	66.022,377
BH - Thesaurierend	JPY	339.447,177	458.405,323	7.169,103	126.127,249

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

Für die Periode vom
01.04.2023 bis zum
31.03.2024

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	319.750.930,31
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.267.013,18
Dividenden (Netto)	915.345,02
Bankzinsen	147.196,02
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	7.927,16
Andere Erträge	184.469,18
	2.521.950,56
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	3.830.124,52
Depotbank- und Depotgebühr	184.089,36
Zentralverwaltungsvergütung	176.725,84
Druck- und Veröffentlichungskosten	8.191,47
Zinsen und Bankspesen	6,39
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	139.220,79
"Taxe d'abonnement"	72.261,00
	4.410.619,37
Nettoerträge (-verluste)	-1.888.668,81
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	7.062.325,74
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-4.756.312,95
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-185.894,58
	2.120.118,21
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	231.449,40
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	28.518.999,67
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-370.124,87
	28.148.874,80
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	28.380.324,20
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	33.106.877,38
Rücknahmen	-78.695.719,24
	-45.588.841,86
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	302.542.412,65

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	49,67
Vereinigte Staaten	23,97
Irland	16,94
Supranational	1,72
Niederlande	1,42
Frankreich	0,87
Deutschland	0,86
Schweiz	0,72
Norwegen	0,57
Mexiko	0,52
Spanien	0,38
Niederländische Antillen	0,33
Finnland	0,25
Italien	0,25
Australien	0,21
Belgien	0,15
Polen	0,12
Kanada	0,11
Österreich	0,08
Portugal	0,07
Total	99,20

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	66,43
Länder und Zentralregierungen	7,15
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	5,90
Banken und andere Kreditinstitute	3,59
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,93
Supranationale Organisationen	1,72
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,37
Telekommunikation	1,32
Computerhardware und Netzwerk	1,22
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	1,06
Baustoffe und Bauindustrie	0,93
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,79
Energie- und Wasserversorgung	0,76
Elektrische Geräte und Komponenten	0,59
Fahrzeuge	0,58
Verkehr und Transport	0,49
Verschiedene Konsumgüter	0,47
Elektronik und Halbleiter	0,46
Petroleum	0,43
Immobilien	0,38
Versicherungsgesellschaften	0,30
Grafikverlags- und Druckmedien	0,25
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,22
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,21
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,16
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,11
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,09
Einzelhandel und Warenhäuser	0,08
Chemie	0,07
Uhrenindustrie, Schmuck	0,04
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,03
Gummi und Reifen	0,02
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,02
Gesundheits- und Sozialdienste	0,02
Diverse Dienstleistungen	0,01
Verpackungsindustrie	0,00
Total	99,20

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	2.630	122.317,51	0,04
EUR ADIDAS REG	297	66.397,32	0,02
USD ADOBE	1.065	537.399,00	0,18
CHF ALCON INC	792	65.720,49	0,02
USD ALPHABET A	14.141	2.134.301,13	0,71
USD ALPHABET C	12.494	1.902.336,44	0,63
EUR AMADEUS IT GROUP A	827	53.089,43	0,02
USD AMERICAN EXPRESS	3.090	703.562,10	0,23
EUR ASML HOLDING	615	592.599,24	0,20
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	1.920	48.646,66	0,02
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	4.455	1.112.591,70	0,37
EUR AXA	3.410	128.216,68	0,04
CHF BALOISE-HOLDING REG	62	9.726,50	0,00
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	40	4.654,19	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	6	8.719,94	0,00
CHF BKW	29	4.456,12	0,00
EUR BMW	534	61.685,97	0,02
EUR BNP PARIBAS A	1.820	129.454,42	0,04
USD CATERPILLAR	4.639	1.699.868,77	0,56
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	767	117.090,21	0,04
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	1.230	47.184,77	0,02
USD COCA-COLA	18.016	1.102.218,88	0,36
USD DANAHER	2.634	657.762,48	0,22
EUR DANONE	1.260	81.498,31	0,03
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	1.020	45.209,66	0,01
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	358	73.326,28	0,02
EUR DEUTSCHE POST REG	2.100	90.527,22	0,03
CHF DUFFY	132	5.500,16	0,00
USD ELI LILLY & CO	3.399	2.644.286,04	0,87
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	7	5.378,07	0,00
EUR ENEL	14.200	93.840,98	0,03
CHF GEBERIT	50	29.588,28	0,01
CHF GVAUDAN REG	14	62.422,95	0,02
CHF HELVETIA HOLDING LTD	46	6.348,21	0,00
EUR HENKEL PREF	333	26.793,18	0,01
EUR HERMES INTERNATIONAL	53	135.429,84	0,04
USD HOME DEPOT	3.615	1.386.714,00	0,46
USD IBERDROLA	10.782	133.854,22	0,04
USD IBM	1.886	360.150,56	0,12
EUR ING GROUP	6.280	103.404,47	0,03
USD INTEL	9.720	429.332,40	0,14
USD INTUIT	641	416.650,00	0,14
USD JOHNSON & JOHNSON	8.243	1.303.960,17	0,43
CHF JULIUS BAER GRUPPE	277	16.016,71	0,01
EUR KERING	137	54.205,15	0,02
EUR KERRY GROUP A	312	26.768,10	0,01
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	1.890	56.582,06	0,02
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	89	24.801,97	0,01
CHF LAFARGEHOLCIM REG	723	65.549,62	0,02
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	23.959,29	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	313	28.064,88	0,01
CHF LONZA REG	118	70.771,61	0,02
EUR L'OREAL	439	207.972,74	0,07
EUR LVMH	462	415.962,95	0,14
USD MASTERCARD	4.135	1.991.291,95	0,66
USD MCDONALD'S	2.411	679.781,45	0,22
EUR MERCK	187	33.040,66	0,01
USD MERCK & CO	7.846	1.035.279,70	0,34
USD MICROSOFT	17.047	7.172.013,84	2,37
EUR MUECHENER RUECKVER REG RESTRICTED	258	126.028,67	0,04
EUR NESTE OYJ	753	20.412,32	0,01
CHF NESTLE REG	3.640	386.956,98	0,13
CHF NOVARTIS REG	2.800	271.608,20	0,09
USD NVIDIA	5.937	5.364.435,72	1,77
EUR ORANGE	3.590	42.214,95	0,01
CHF PARTNERS GROUP	28	40.040,22	0,01
USD PROCTER & GAMBLE	8.599	1.395.187,75	0,46
USD PROLOGIS	8.214	1.069.627,08	0,35
EUR REPSOL	1.880	31.349,38	0,01
CHF ROCHE HOLDING	42	11.331,26	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	920	234.623,41	0,08
USD S&P GLOBAL	1.597	679.443,65	0,22
USD SALESFORCE.COM	2.102	633.080,36	0,21
CHF SANDOZ GROUP LTD	485	14.651,86	0,00
USD SCHLUMBERGER	18.112	992.718,72	0,33
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	1.270	287.555,94	0,10
USD SEMPRA ENERGY	5.966	428.537,78	0,14
CHF SGS LTD	245	23.801,08	0,01
USD SHERWIN-WILLIAMS	3.807	1.322.285,31	0,44
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	458	10.169,93	0,00
CHF SIKA LTD	210	62.625,01	0,02
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	1.390	37.244,77	0,01
CHF SONOVA HOLDING REG	80	23.190,99	0,01
EUR STMICROELECTRONICS	1.050	45.286,29	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	163	26.069,89	0,01
CHF SWISS LIFE REG	40	28.076,11	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	106	10.009,28	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	440	56.642,96	0,02
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	35	21.426,80	0,01
EUR SYMRISE	616	73.812,82	0,02
USD TESLA MOTORS	9.578	1.683.716,62	0,56
USD TEXAS INSTRUMENTS	2.131	371.241,51	0,12
CHF THE SWATCH GROUP	30	6.974,62	0,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettvermö- gens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettvermö- gens
EUR TOTAL ENERGIES	3.700	253.626,12	0,08	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD	3.947	5.764.028,08	1,91
CHF UBS GROUP	4.450	137.053,14	0,05	BOND FUND -MB- USD			
USD UNION PACIFIC	5.579	1.372.043,47	0,45	USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND	1.374	3.711.434,58	1,23
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	1.750	52.693,20	0,02	EB USD			
EUR UPM-KYMMENE	2.700	90.016,92	0,03	USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND	1.960	5.140.942,80	1,70
CHF VAT GROUP	41	21.271,70	0,01	B USD			
USD VERIZON COMMUNICATIONS	12.108	508.051,68	0,17	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE	37.730	5.726.780,14	1,89
USD VISA A	7.187	2.005.747,96	0,66	BOND FUND -EB- EUR			
EUR VONOVIA REG	1.910	56.520,72	0,02	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG	174.506	36.733.513,00	12,14
EUR WOLTERS KLUWER	574	90.012,38	0,03	LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	739	145.139,60	0,05
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	213	115.002,26	0,04	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD			
Total Aktien		51.180.705,62	16,92	ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			
Anleihen				USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	179	166.445,84	0,06
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	2.000.000	1.906.400,00	0,63	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
USD APPLE INC 4.3%/23-100533	1.000.000	993.360,00	0,33	LOCAL -QBX USD- USD			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	1.000.000	950.540,00	0,31	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	7.281	7.133.268,51	2,36
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED)	400.000	385.460,64	0,13	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
2.124%/19-01.10.2030				USD -QBX USD- USD			
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	250.000	256.772,70	0,08	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	17.773	18.931.715,61	6,26
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	1.750.000	1.642.900,00	0,54	(LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -			
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	300.000	300.140,64	0,10	QBX- USD			
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	200.000	190.496,88	0,06	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	2.983	4.801.371,17	1,59
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	250.000	254.380,50	0,08	(LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR			
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	100.000	94.026,96	0,03	ACC- EUR			
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	100.000	101.937,96	0,03	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	5.050	6.485.068,22	2,14
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	450.000	318.621,80	0,11	(LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY			
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-150229	250.000	244.989,90	0,08	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	1.623	2.685.384,91	0,89
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	2.000.000	1.568.200,00	0,52	(LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP			
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	500.000	526.694,40	0,17	ACC- GBP			
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	1.500.000	1.453.635,00	0,48	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	2.567	3.192.988,62	1,06
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	1.000.000	869.380,00	0,29	(LUX)EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.000.000	975.820,00	0,32	USD ACC- USD			
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	150.000	147.507,48	0,05	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV -	4.221	4.026.173,77	1,33
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	500.000	490.417,20	0,16	CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX			
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	400.000	400.204,80	0,13	CAD ACC- CAD			
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	250.000	223.897,50	0,07	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX)	1.819	2.999.989,03	0,99
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	150.000	137.024,46	0,05	GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND			
EUR IBERDROLA FINANZAS 3.375%/22-221132	300.000	323.889,84	0,11	EB USD			
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL 1.125%/16-21.04.2026	200.000	207.148,32	0,07	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT	38.642	45.032.572,49	14,88
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	2.000.000	1.977.460,00	0,65	SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -			
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	500.000	504.549,00	0,17	EB- USD			
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	250.000	242.335,80	0,08	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	1.483	2.949.850,13	0,98
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	1.000.000	951.220,00	0,31	SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -			
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	500.000	499.370,40	0,17	EB- USD			
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	2.000.000	1.752.400,00	0,58	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	236	186.506,08	0,06
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	1.500.000	1.460.370,00	0,48	SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP			
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	150.000	154.099,26	0,05	USD -USD			
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	100.000	104.726,52	0,03	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	2.561	3.271.575,06	1,08
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	100.000	106.330,32	0,04	SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY			
USD PEPSICO INC 3.9%/22-180732	1.000.000	947.120,00	0,31	FUND -EBP USD ACC- USD			
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	350.000	361.972,80	0,12	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	248	344.897,52	0,11
EUR SPAIN 2.75%/14-311024	100.000	107.421,12	0,04	SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY			
EUR SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT 0.5%/18-30.01.2025	250.000	263.209,50	0,09	FUND -EB- CHF			
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	2.000.000	1.731.280,00	0,57	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	2.281	2.998.169,21	0,99
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	500.000	338.271,04	0,11	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE			
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	499.000	299.050,22	0,10	BOND FUND -EB- USD			
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	1.500.000	1.460.097,66	0,48	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	3.699	4.832.558,55	1,60
USD US 4.5%/06-15.02.2036	2.000.000	2.079.062,50	0,69	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE			
USD US TREASURY 1.625%/16-150526	2.500.000	2.350.000,00	0,78	INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD			
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	2.000.000	1.719.375,00	0,57	USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT	7.477	7.540.112,79	2,49
USD US TREASURY N/B 1.875%/19-31.07.2026	1.000.000	941.250,00	0,31	SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES			
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	2.500.000	2.325.585,95	0,77	FUND -EA- USD			
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	1.500.000	1.416.562,50	0,47	USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	67.546	7.555.695,56	2,50
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	2.000.000	1.830.156,26	0,60	USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	36.443	6.285.688,64	2,08
USD US TREASURY N/B S C-2032 2.875%/22-15053	2.250.000	2.043.984,38	0,68	Total Fondsanteile (Open-End)		200.978.263,87	66,43
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	2.000.000	1.601.875,00	0,53	Total Investmentfonds		200.978.263,87	66,43
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	2.000.000	1.914.600,00	0,63	Total des Wertpapierbestandes		300.122.691,70	99,20
USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037	1.500.000	1.516.140,00	0,50	Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.584.545,37	0,85
Total Anleihen		47.963.722,21	15,85	Andere Passiva		-164.824,42	-0,05
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		99.144.427,83	32,77	Fondsvermögen		302.542.412,65	100,00
Investmentfonds							
Fondsanteile (Open-End)							
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION	8.598	7.070.135,40	2,34				
FUND -EB- USD							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND	105	304.172,86	0,10				
PLUS EQUITY FUND EB EUR							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY	19.378	4.962.085,70	1,64				
GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR							

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	EUR	951292	LU0091101195	1,70%	2,11%
EB - Thesaurierend	EUR	28344652	LU1237499287	0,60%	0,98%
IA - Ausschüttend	EUR	29019344	LU1267071774	0,60%	0,99%
IB - Thesaurierend	EUR	1057479	LU0108837765	0,60%	/
UB - Thesaurierend	EUR	26362750	LU1144411474	1,40%	1,80%

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR -IB- wurde am 10.11.2023 geschlossen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	EUR	6,66%	/	11,48%	-15,01%	16,69%
EB - Thesaurierend	EUR	6,95%	7,62%	12,73%	-14,05%	/
IA - Ausschüttend	EUR	6,95%	/	12,71%	-14,07%	17,98%
IB - Thesaurierend	EUR	/	/	/	-14,07%	17,98%
UB - Thesaurierend	EUR	6,73%	/	11,82%	-14,75%	17,04%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
<i>Gegenpartei</i>					
GBP	280.000	EUR	-327.157	10.05.2024	-161,62
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	9.163.364	USD	-9.900.000	10.05.2024	13.131,60
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>					
AUD	470.000	EUR	-283.792	10.05.2024	-62,36
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					12.907,62

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	94.482.328,43
Bareinlagen bei Banken und Brokern	1.358.182,73
Forderungen aus Erträgen	124.798,79
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	12.907,62
	95.978.217,57
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	119.534,62
	119.534,62
Nettovermögen	95.858.682,95

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	EUR	95.858.682,95	118.475.431,11	153.417.346,72
Nettoinventarwert pro Aktie				
B - Thesaurierend	EUR	226,55	199,88	212,91
EB - Thesaurierend	EUR	1.076,23	939,02	989,13
IA - Ausschüttend	EUR	1.482,74	1.293,94	1.363,23
IB - Thesaurierend	EUR	/	1.594,61	1.680,00
UB - Thesaurierend	EUR	143,92	126,60	134,45

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
B - Thesaurierend	EUR	244.337,126	392.347,416	14.413,697	162.423,987
EB - Thesaurierend	EUR	4.609,040	4.660,040	0,000	51,000
IA - Ausschüttend	EUR	9.675,495	9.866,049	0,000	190,554
IB - Thesaurierend	EUR	0,000	1.172,480	0,000	1.172,480
UB - Thesaurierend	EUR	147.282,120	166.216,295	4.449,016	23.383,191

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	118.475.431,11
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	143.336,90
Dividenden (Netto)	574.702,80
Bankzinsen	35.353,40
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	785,14
Andere Erträge	60.944,22
	815.122,46
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.419.212,16
Depotbank- und Depotgebühr	61.901,84
Zentralverwaltungsvergütung	59.495,98
Druck- und Veröffentlichungskosten	6.368,24
Zinsen und Bankspesen	585,60
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	47.755,96
"Taxe d'abonnement"	22.875,44
	1.618.195,22
Nettoerträge (-verluste)	-803.072,76
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	4.978.349,05
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-150.237,63
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	22.394,57
	4.850.505,99
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	4.047.433,23
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	9.022.561,92
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-92.542,92
	8.930.019,00
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	12.977.452,23
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	3.506.507,12
Rücknahmen	-39.100.707,51
	-35.594.200,39
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	95.858.682,95

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	50,41
Irland	18,46
Vereinigte Staaten	11,90
Frankreich	5,80
Niederlande	3,56
Deutschland	2,79
Schweiz	1,34
Spanien	1,07
Italien	1,01
Finnland	0,57
Supranational	0,43
Niederländische Antillen	0,22
Polen	0,20
Portugal	0,20
Mexiko	0,19
Australien	0,12
Grossbritannien	0,10
Kanada	0,10
Belgien	0,09
Total	98,56

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	68,55
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	4,29
Banken und andere Kreditinstitute	2,58
Länder und Zentralregierungen	2,46
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	2,26
Elektronik und Halbleiter	1,99
Energie- und Wasserversorgung	1,74
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	1,47
Elektrische Geräte und Komponenten	1,35
Versicherungsgesellschaften	1,28
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,25
Petroleum	1,15
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,89
Einzelhandel und Warenhäuser	0,75
Baustoffe und Bauindustrie	0,67
Fahrzeuge	0,66
Verkehr und Transport	0,60
Telekommunikation	0,58
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,54
Grafikverlags- und Druckmedien	0,43
Supranationale Organisationen	0,43
Computerhardware und Netzwerk	0,43
Immobilien	0,42
Verschiedene Konsumgüter	0,40
Chemie	0,31
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,27
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,16
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,15
Gummi und Reifen	0,14
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,12
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,10
Uhrenindustrie, Schmuck	0,08
Gesundheits- und Sozialdienste	0,04
Verpackungsindustrie	0,01
Diverse Dienstleistungen	0,01
Total	98,56

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	1.680	72.346,65	0,08
EUR ADIDAS REG	936	193.752,00	0,20
USD ADOBE	247	115.403,89	0,12
CHF ALCON INC	506	38.877,86	0,04
USD ALPHABET A	3.291	459.917,25	0,48
USD ALPHABET C	2.903	409.269,24	0,43
EUR AMADEUS IT GROUP A	2.610	155.138,40	0,16
USD AMERICAN EXPRESS	720	151.793,33	0,16
EUR ASML HOLDING	1.940	1.730.868,00	1,81
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	6.050	141.933,00	0,15
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	1.038	240.027,89	0,25
EUR AXA	10.700	372.520,50	0,39
CHF BALOISE-HOLDING REG	39	5.665,07	0,01
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	26	2.801,13	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	5	6.728,35	0,01
CHF BKW	19	2.703,26	0,00
EUR BMW	1.680	179.692,80	0,19
EUR BNP PARIBAS A	5.740	379.036,40	0,39
USD CATERPILLAR	1.077	365.412,14	0,38
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	490	69.262,40	0,07
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	3.890	138.172,80	0,14
USD COCA-COLA	4.194	237.582,33	0,25
USD DANAHER	612	141.508,00	0,15
EUR DANONE	3.970	237.763,30	0,25
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	3.210	131.738,40	0,14
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	1.130	214.304,50	0,22
EUR DEUTSCHE POST REG	6.630	264.636,45	0,28
CHF DUFFY	84	3.240,83	0,00
USD ELI LILLY & CO	792	570.504,00	0,60
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	4	2.845,54	0,00
EUR ENEL	44.900	274.743,10	0,29
CHF GEBERIT	32	17.533,80	0,02
CHF GVAUDAN REG	9	37.156,52	0,04
CHF HELVETIA HOLDING LTD	29	3.705,68	0,00
EUR HENKEL PREF	1.050	78.225,00	0,08
EUR HERMES INTERNATIONAL	166	392.756,00	0,41
USD HOME DEPOT	841	298.710,74	0,31
EUR IBERDROLA	33.874	389.381,63	0,41
USD IBM	459	81.158,00	0,08
EUR ING GROUP	19.800	301.870,80	0,31
USD INTEL	2.252	92.102,63	0,10
USD INTUIT	152	91.481,48	0,10
USD JOHNSON & JOHNSON	1.922	281.519,61	0,29
CHF JULIUS BAER GRUPPE	177	9.476,39	0,01
EUR KERING	430	157.530,50	0,16
EUR KERRY GROUP A	984	78.168,96	0,08
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	5.960	165.211,20	0,17
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	57	14.707,79	0,02
CHF LAFARGEHOLCIM REG	462	38.783,78	0,04
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	11.092,26	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	200	16.604,47	0,02
CHF LONZA REG	75	41.649,96	0,04
EUR L'OREAL	1.380	605.337,00	0,63
EUR LVMH	1.460	1.217.202,00	1,27
USD MASTERCARD	964	429.845,81	0,45
USD MCDONALD'S	562	146.718,43	0,15
EUR MERCK	588	96.196,80	0,10
USD MERCK & CO	2.029	247.894,95	0,26
USD MICROSOFT	3.961	1.543.029,56	1,61
EUR MUECHENER RUECKVER REG RESTRICTED	811	366.815,30	0,38
EUR NESTLE OYJ	2.370	59.487,00	0,06
CHF NESTLE REG	2.330	229.347,21	0,24
CHF NOVARTIS REG	1.790	160.773,37	0,17
USD NVIDIA	1.388	1.161.241,93	1,21
CHF ORANGE	11.300	123.034,40	0,13
CHF PARTNERS GROUP	18	23.833,46	0,02
USD PROCTER & GAMBLE	2.000	300.462,96	0,31
USD PROLOGIS	1.912	230.537,63	0,24
EUR REPSOL	5.930	91.559,20	0,10
CHF ROCHE HOLDING	27	6.744,80	0,01
CHF ROCHE HOLDING CERT	588	138.847,19	0,14
USD S&P GLOBAL	371	146.149,95	0,15
USD SALESFORCE.COM	489	136.367,61	0,14
CHF SANDOZ GROUP LTD	310	8.671,40	0,01
USD SCHLUMBERGER	4.233	214.824,75	0,22
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	3.990	836.503,50	0,87
USD SEMPRA ENERGY	1.388	92.314,85	0,10
CHF SGS LTD	157	14.122,33	0,01
USD SHERWIN-WILLIAMS	887	285.260,84	0,30
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	293	6.024,16	0,01
CHF SIKA LTD	134	37.000,67	0,04
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	4.390	108.915,90	0,11
CHF SONOVA HOLDING REG	51	13.689,13	0,01
EUR STMICROELECTRONICS	3.310	132.184,85	0,14
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	104	15.395,53	0,02
CHF SWISS LIFE REG	25	16.247,75	0,02
CHF SWISS PRIME SITE	67	5.857,98	0,01
CHF SWISS REINSURANCE	281	33.494,68	0,03
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	22	12.470,62	0,01
EUR SYMRISE	1.940	215.243,00	0,22
USD TESLA MOTORS	2.233	363.462,10	0,38
USD TEXAS INSTRUMENTS	496	80.007,56	0,08
CHF THE SWATCH GROUP	20	4.305,32	0,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
EUR TOTAL ENERGIES	11.600	736.252,00	0,77
CHF UBS GROUP	2.840	80.988,54	0,08
USD UNION PACIFIC	1.301	296.254,56	0,31
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	5.520	153.897,60	0,16
EUR UPM-KYMMENE	8.500	262.395,00	0,27
CHF VAT GROUP	26	12.490,16	0,01
USD VERIZON COMMUNICATIONS	2.825	109.756,48	0,11
USD VISA A	1.679	433.866,04	0,45
EUR VONOVIA REG	6.020	164.948,00	0,17
EUR WOLTERS KLUWER	1.810	262.812,00	0,27
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	136	67.989,51	0,07
Total Aktien		22.447.089,38	23,42
Anleihen			
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	250.000	236.222,50	0,25
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	250.000	220.648,15	0,23
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	250.000	223.067,50	0,23
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	250.000	217.314,81	0,23
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	200.000	185.272,00	0,19
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	100.000	88.193,00	0,09
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17- 18.06.2027	150.000	98.340,06	0,10
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19- 150229	100.000	90.737,00	0,09
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20- 01.09.2032	250.000	181.504,63	0,19
EUR DAIMLER AG 0.75%/20-10.09.2030	100.000	87.052,00	0,09
EUR DEUTSCHLAND 2.3%/23-150233	250.000	251.005,00	0,26
EUR E.ON SE 0.875%/20-200831	200.000	167.920,00	0,18
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	100.000	97.536,00	0,10
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23- 280728	100.000	100.239,00	0,10
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18- 13.06.2025	100.000	90.353,70	0,09
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	250.000	227.045,00	0,24
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	100.000	82.925,00	0,09
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	50.000	42.291,50	0,04
EUR IBERDROLA FINANZAS 3.375%/22-221132	200.000	199.932,00	0,21
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	250.000	233.587,50	0,24
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	100.000	89.754,00	0,09
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	250.000	220.189,81	0,23
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	250.000	231.190,00	0,24
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	250.000	202.824,07	0,21
EUR KFW 2.75%/23-140233	100.000	100.542,00	0,10
EUR NATURGY FINANCE 0.875%/17-150525	200.000	194.036,00	0,20
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	150.000	142.684,50	0,15
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	100.000	96.969,00	0,10
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	100.000	98.454,00	0,10
USD PEPSICO INC 3.9%/22-180732	250.000	219.240,74	0,23
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	200.000	191.520,00	0,20
EUR SSE PLC 0.875%/17-06.09.2025	100.000	96.229,00	0,10
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S.-B- 2.15%/20- 13.02.2030	100.000	80.151,85	0,08
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11- 17.11.2026	100.000	62.642,79	0,07
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	89.000	49.386,68	0,05
USD US 4.5%/06-15.02.2036	100.000	96.252,90	0,10
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	250.000	215.332,04	0,22
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	250.000	218.605,32	0,23
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	250.000	211.823,64	0,22
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	100.000	74.160,88	0,08
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19- 08.02.2029	250.000	221.597,22	0,23
USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17- 16.03.2037	100.000	93.588,89	0,10
Total Anleihen		6.328.361,68	6,60
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		28.775.451,06	30,02

Investmentfonds

Fondsanteile (Open-End)			
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	2.801	2.132.650,28	2,22
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	37	98.990,61	0,10
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	23.001	5.453.537,10	5,69
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	629	851.120,09	0,89
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	460	1.149.885,47	1,20
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	946	2.297.492,39	2,40
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	38.848	5.459.697,92	5,70
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	64.196	12.512.275,93	13,05
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	4.975	904.712,96	0,94
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	65	56.359,44	0,06
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	1.193	1.082.216,69	1,13

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - QBX- USD	8.864	8.742.448,30	9,12
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	2.712	4.041.829,20	4,22
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	2.928	3.481.532,77	3,63
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	1.105	1.692.881,46	1,77
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX)EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	1.446	1.665.390,33	1,74
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	1.929	1.703.670,63	1,78
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	628	959.223,48	1,00
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	1.248	1.346.649,78	1,40
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	730	1.344.491,02	1,40
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	75	54.880,56	0,06
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	843	997.128,50	1,04
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	158	203.456,57	0,21
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	457	556.190,16	0,58
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	561	678.628,19	0,71
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	2.434	2.272.235,56	2,37
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	22.251	2.304.626,72	2,40
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	10.411	1.662.675,26	1,73
Total Fondsanteile (Open-End)		65.706.877,37	68,55
Total Investmentfonds		65.706.877,37	68,55
Total des Wertpapierbestandes		94.482.328,43	98,56
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.358.182,73	1,42
Andere Nettovermögenswerte		18.171,79	0,02
Fondsvermögen		95.858.682,95	100,00

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	CHF	672378	LU0078041992	1,70%	2,07%
IB - Thesaurierend	CHF	1057460	LU0108837336	0,60%	0,98%
UB - Thesaurierend	CHF	26362874	LU1144411557	1,40%	1,78%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	CHF	8,56%	/	4,35%	-18,16%	12,70%
IB - Thesaurierend	CHF	8,85%	/	5,50%	-17,25%	13,94%
UB - Thesaurierend	CHF	8,64%	/	4,66%	-17,91%	13,03%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In CHF)
<i>Gegenpartei</i>					
EUR	260.000	CHF	-248.525	10.05.2024	3.640,78
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	281.127	CAD	-440.000	10.05.2024	-10.540,02
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
AUD	850.000	CHF	-477.125	10.05.2024	20.540,52
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	23.781.567	USD	-27.640.000	10.05.2024	-1.000.154,40
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	750.000	CHF	-814.615	10.05.2024	34.872,75
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	5.810.306	EUR	-6.250.000	10.05.2024	-252.109,69
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-1.203.750,06

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	246.267.302,08
Bareinlagen bei Banken und Brokern	3.372.431,86
Forderungen aus Erträgen	296.089,12
	249.935.823,06
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	344.551,86
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	1.203.750,06
	1.548.301,92
Nettovermögen	248.387.521,14

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	CHF	248.387.521,14	260.126.595,99	305.250.667,91
Nettoinventarwert pro Aktie				
B - Thesaurierend	CHF	238,40	218,48	243,71
IB - Thesaurierend	CHF	1.362,30	1.234,88	1.362,43
UB - Thesaurierend	CHF	135,79	124,07	137,98

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
B - Thesaurierend	CHF	719.090,302	793.093,538	37.941,786	111.945,022
IB - Thesaurierend	CHF	3.263,295	5.586,336	0,000	2.323,041
UB - Thesaurierend	CHF	533.984,202	644.413,361	17.150,716	127.579,875

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	260.126.595,99
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	269.005,77
Dividenden (Netto)	1.543.812,78
Bankzinsen	40.038,20
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.563,05
Andere Erträge	152.104,41
	2.007.524,21
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	3.845.622,89
Depotbank- und Depotgebühr	151.492,23
Zentralverwaltungsvergütung	145.408,32
Druck- und Veröffentlichungskosten	5.070,27
Zinsen und Bankspesen	9,09
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	67.539,08
"Taxe d'abonnement"	61.624,65
	4.276.766,53
Nettoerträge (-verluste)	-2.269.242,32
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	5.520.850,17
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	569.358,79
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	198.370,85
	6.288.579,81
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	4.019.337,49
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	18.832.377,59
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-1.463.272,06
	17.369.105,53
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	21.388.443,02
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	10.488.759,51
Rücknahmen	-43.616.277,38
	-33.127.517,87
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	248.387.521,14

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	48,90
Schweiz	20,51
Irland	12,75
Vereinigte Staaten	11,38
Kanada	1,05
Frankreich	0,82
Deutschland	0,68
Österreich	0,62
Niederlande	0,45
Supranational	0,35
Australien	0,33
Niederländische Antillen	0,23
Italien	0,20
Chile	0,19
Vereinigte Arabische Emirate	0,19
Belgien	0,13
Finnland	0,11
Polen	0,09
Spanien	0,08
Mexiko	0,07
Total	99,15

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	61,56
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	7,06
Banken und andere Kreditinstitute	4,72
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	4,39
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	4,11
Versicherungsgesellschaften	2,17
Elektrische Geräte und Komponenten	1,66
Baustoffe und Bauindustrie	1,52
Chemie	1,32
Länder und Zentralregierungen	1,20
Uhrenindustrie, Schmuck	1,17
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,97
Verkehr und Transport	0,77
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,74
Gesundheits- und Sozialdienste	0,62
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,57
Computerhardware und Netzwerk	0,54
Telekommunikation	0,49
Fahrzeuge	0,40
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,37
Supranationale Organisationen	0,35
Immobilien	0,35
Verschiedene Konsumgüter	0,33
Elektronik und Halbleiter	0,31
Petroleum	0,29
Energie- und Wasserversorgung	0,27
Diverse Dienstleistungen	0,22
Grafikverlags- und Druckmedien	0,18
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,16
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,10
Verpackungsindustrie	0,10
Einzelhandel und Warenhäuser	0,10
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,02
Gummi und Reifen	0,01
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,01
Total	99,15

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	66.349	2.779.359,61	1,12
EUR ADIDAS REG	168	33.828,35	0,01
USD ADOBE	676	307.235,52	0,12
CHF ALCON INC	20.573	1.537.626,02	0,62
USD ALPHABET A	8.993	1.222.524,72	0,49
USD ALPHABET C	7.921	1.066.283,85	0,44
EUR AMADEUS IT GROUP A	468	27.059,88	0,01
USD AMERICAN EXPRESS	1.965	402.980,47	0,16
EUR ASML HOLDING	348	302.024,87	0,12
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	1.090	24.874,58	0,01
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	2.830	636.578,59	0,26
EUR AXA	1.930	65.361,94	0,03
CHF BALOISE-HOLDING REG	1.604	226.645,20	0,09
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	1.050	1110.040,00	0,04
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	140	183.260,00	0,07
CHF BKW	756	104.630,40	0,04
EUR BMW	302	31.421,69	0,01
EUR BNP PARIBAS A	1.030	65.987,27	0,03
USD CATERPILLAR	2.953	974.612,45	0,39
CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI	4	435.200,00	0,18
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	19.882	2.733.775,00	1,10
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	698	24.117,35	0,01
USD COCA-COLA	11.476	632.379,08	0,25
USD DANAHER	1.673	376.293,53	0,15
EUR DANONE	713	41.537,95	0,02
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	576	22.994,88	0,01
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	203	37.449,85	0,02
EUR DEUTSCHE POST REG	1.190	46.204,51	0,02
CHF DUFFY	3.423	128.465,19	0,05
USD ELI LILLY & CO	2.163	1.515.623,29	0,61
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	184	127.328,00	0,05
EUR ENEL	8.050	47.915,67	0,02
CHF GEBERIT	1.307	696.631,00	0,28
CHF GIVAUDAN REG	363	1.457.808,00	0,59
CHF HELVETIA HOLDING LTD	1.187	147.544,10	0,06
EUR HENKEL PREF	188	13.624,34	0,01
EUR HERMES INTERNATIONAL	30	69.045,80	0,03
USD HOME DEPOT	2.295	792.937,16	0,32
EUR IBERDROLA	6.072	67.895,65	0,03
USD IBM	1.250	214.996,76	0,09
EUR ING GROUP	3.550	52.648,44	0,02
USD INTEL	6.143	244.391,11	0,10
USD INTUIT	416	243.547,78	0,10
USD JOHNSON & JOHNSON	5.239	746.457,20	0,30
CHF JULIUS BAER GRUPPE	7.190	374.455,20	0,15
EUR KERING	77	27.440,26	0,01
EUR KERRY GROUP A	177	13.677,72	0,01
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	1.070	28.852,15	0,01
CHF KUEHNE & NAGEL-INTERNATIONAL	2.316	581.316,00	0,23
CHF LAFARGEHOLCIM REG	18.794	1.534.718,04	0,62
CHF LINDT & SPRUENGLI	35	377.650,00	0,15
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	8.130	656.578,80	0,26
CHF LONZA REG	3.067	1.656.793,40	0,67
EUR L'OREAL	248	105.820,80	0,04
EUR LVMH	261	211.666,22	0,09
USD MASTERCARD	2.633	1.142.056,97	0,46
USD MCDONALD'S	1.533	389.306,57	0,16
EUR MERCK	105	16.709,90	0,01
USD MERCK & CO	5.531	657.340,72	0,26
USD MICROSOFT	10.818	4.099.374,72	1,65
EUR MUENCHENER RUECKVER REG RESTRICTED	146	64.236,32	0,03
EUR NESTE OYJ	425	10.376,81	0,00
CHF NESTLE REG	94.554	9.053.545,50	3,64
CHF NOVARTIS REG	72.697	6.351.536,89	2,56
USD NVIDIA	3.772	3.069.772,31	1,24
EUR ORANGE	2.030	21.500,34	0,01
CHF PARTNERS GROUP	723	931.224,00	0,37
USD PROCTER & GAMBLE	5.465	796.642,39	0,32
USD PROLOGIS	5.220	612.245,61	0,25
EUR REPSOL	1.060	15.920,42	0,01
CHF ROCHE HOLDING	1.089	264.627,00	0,11
CHF ROCHE HOLDING CERT	23.838	5.475.588,60	2,20
USD S&P GLOBAL	1.015	388.948,46	0,16
USD SALESFORCE.COM	1.335	362.146,99	0,15
CHF SANDOZ GROUP LTD	12.561	341.784,81	0,14
USD SCHLUMBERGER	11.571	571.226,28	0,23
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	715	145.814,98	0,06
USD SEMPRA ENERGY	3.790	245.201,18	0,10
CHF SGS LTD	6.361	556.587,50	0,22
USD SHERWIN-WILLIAMS	2.417	756.129,93	0,30
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	11.869	237.380,00	0,10
CHF SIKA LTD	5.441	1.461.452,60	0,59
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	788	19.017,53	0,01
CHF SONOVA HOLDING REG	2.089	545.437,90	0,22
EUR STMICROELECTRONICS	593	23.036,14	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	4.234	609.696,00	0,25
CHF SWISS LIFE REG	1.029	650.533,80	0,26
CHF SWISS PRIME SITE	2.741	233.122,05	0,09
CHF SWISS REINSURANCE	11.376	1.319.047,20	0,53
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	917	505.633,80	0,20
EUR SYMRISE	348	37.558,46	0,02
USD TESLA MOTORS	6.085	963.456,77	0,39
USD TEXAS INSTRUMENTS	1.353	212.299,20	0,09

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 Nettovermö- gens
CHF THE SWATCH GROUP	812	170.032,80	0,07
EUR TOTAL ENERGIES	2.090	129.037,52	0,05
CHF UBS GROUP	115.718	3.210.017,32	1,29
USD UNION PACIFIC	3.546	785.466,60	0,32
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	991	26.876,19	0,01
EUR UPM-KYMMENE	1.520	45.643,76	0,02
CHF VAT GROUP	1.068	499.073,40	0,20
USD VERIZON COMMUNICATIONS	7.713	291.498,48	0,12
USD VISA A	4.571	1.148.993,10	0,46
EUR VONOVIA REG	1.080	28.785,62	0,01
EUR WOLTERS KLUWER	325	45.904,07	0,02
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	5.519	2.683.889,70	1,08
Total Aktien		78.832.852,85	31,74

Anleihen			
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	250.000	214.635,49	0,09
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	250.000	214.036,52	0,09
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	250.000	216.988,91	0,09
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	250.000	211.392,99	0,09
CHF BANCO DE CREDITO E 0.5994%/22-260427	500.000	478.500,00	0,19
CHF BAWAG P.S.K. 2.955%/22-291127	1.500.000	1.551.750,00	0,62
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	100.000	85.789,74	0,03
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	250.000	229.119,10	0,09
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	50.000	42.344,78	0,02
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	50.000	45.907,48	0,02
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	200.000	127.547,06	0,05
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	250.000	176.558,63	0,07
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	500.000	487.500,00	0,20
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA S. -3221A-0.25%/19-30.10.2026	200.000	179.851,75	0,07
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	250.000	220.858,02	0,09
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	500.000	473.500,00	0,19
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	250.000	222.635,90	0,09
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	250.000	227.222,24	0,09
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	250.000	218.270,51	0,09
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	200.000	171.351,71	0,07
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	250.000	197.297,12	0,08
EUR KFW 2.75%/23-140233	250.000	244.505,58	0,10
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028	1.000.000	937.500,00	0,38
CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028	500.000	473.500,00	0,19
CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.05%/21-120533	500.000	445.500,00	0,18
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	250.000	211.264,28	0,09
CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029	250.000	238.125,00	0,10
CHF PROVINCE OF QUEBEC 2.04%/23-090533	1.500.000	1.590.000,00	0,64
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	250.000	232.876,35	0,09
USD ROYAL BANK OF CANADA S H 1.15%/21-140726	250.000	206.301,81	0,08
CHF SCNF RESEAU 3.25%/06-300632	500.000	573.250,00	0,23
CHF SOCIETE NATIONALE SNCF 1.5825%/24-070239	500.000	509.500,00	0,21
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	400.000	243.743,08	0,10
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	178.000	96.081,79	0,04
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	250.000	219.183,64	0,09
USD US 4.5%/06-15.02.2036	250.000	234.075,00	0,09
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	250.000	221.101,14	0,09
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	300.000	251.357,08	0,10
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	500.000	425.296,66	0,17
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	500.000	412.102,90	0,17
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	500.000	360.699,98	0,15
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	200.000	172.446,96	0,07
USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037	250.000	227.596,48	0,09
Total Anleihen		14.519.065,68	5,85

Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere	93.351.918,53	37,58
--	----------------------	--------------

Investmentfonds

Fondsanteile (Open-End)			
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	7.689	5.694.788,97	2,29
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	203	526.876,65	0,21
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	24.241	5.590.920,61	2,25
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	1.708	2.246.189,18	0,90
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	1.518	3.692.479,58	1,49
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	2.334	5.513.978,09	2,22
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	24.320	3.324.794,13	1,34
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	110.530	20.956.065,84	8,44
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	7.888	1.395.358,72	0,56

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	128	107.704,89	0,04
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	3.361	2.965.848,51	1,19
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD	24.669	23.667.835,34	9,53
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR	2.704	3.920.091,45	1,58
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	6.840	7.911.462,19	3,19
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP	2.682	3.996.909,20	1,61
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	3.284	3.679.189,31	1,48
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	6.177	5.306.794,24	2,14
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	1.723	2.560.039,55	1,03
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	6.023	6.321.995,48	2,55
CHF CS INVESTMENT FUNDS 14 - CREDIT SUISSE (LUX) SWISS FRANC BOND FUND -EB-	82.586	9.920.230,32	3,99
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -EB- USD	2.062	3.694.238,63	1,49
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	187	133.106,75	0,05
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	2.882	3.316.032,44	1,34
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	6.229	7.802.507,69	3,14
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	1.293	1.530.759,15	0,62
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	1.495	1.759.184,82	0,71
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	6.688	6.074.699,93	2,45
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	61.898	6.236.327,52	2,51
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	19.755	3.068.974,37	1,24

Total Fondsanteile (Open-End)	152.915.383,55	61,56
Total Investmentfonds	152.915.383,55	61,56
Total des Wertpapierbestandes	246.267.302,08	99,15
Bareinlagen bei Banken und Brokern	3.372.431,86	1,36
Andere Passiva	-1.252.212,80	-0,51
Fondsvermögen	248.387.521,14	100,00

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	USD	672380	LU0078042453	1,70%	2,08%
EB - Thesaurierend	USD	28146665	LU1230137272	0,60%	0,96%
UB - Thesaurierend	USD	26362879	LU1144411631	1,40%	1,78%
IB - Thesaurierend	USD	28234316	LU1230137512	0,60%	0,98%
BH - Thesaurierend	JPY	36829025	LU1614285234	1,70%	2,18%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
B - Thesaurierend	USD	5,82%	/	15,66%	-19,18%	12,68%
EB - Thesaurierend	USD	6,11%	/	16,96%	-18,27%	13,95%
UB - Thesaurierend	USD	5,89%	/	16,02%	-18,94%	13,01%
IB - Thesaurierend	USD	6,10%	5,27%	16,94%	-18,29%	/
BH - Thesaurierend	JPY	4,50%	/	9,04%	-21,28%	12,14%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
JPY	204.100	USD	-1.351	09.04.2024	-0,23
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
JPY	782.663.300	USD	-5.313.223	09.04.2024	-132.385,51
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	782.867.400	USD	-5.194.091	23.04.2024	-840,44
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	215.345	CAD	-290.000	10.05.2024	928,06
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	3.133.085	EUR	-2.900.000	10.05.2024	-4.524,58
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	180.000	USD	-195.133	10.05.2024	-384,66
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	410.000	USD	-517.521	10.05.2024	526,44
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-136.680,92

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	160.727.633,19
Bareinlagen bei Banken und Brokern	1.851.068,12
Forderungen aus Erträgen	187.329,07
	162.766.030,38
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	229.009,16
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	136.680,92
	365.690,08
Nettovermögen	162.400.340,30

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	USD	162.400.340,30	178.601.578,91	216.699.854,49
Nettoinventarwert pro Aktie				
B - Thesaurierend	USD	359,73	309,88	343,81
EB - Thesaurierend	USD	1.675,77	1.427,56	1.566,17
UB - Thesaurierend	USD	161,71	138,89	153,63
IB - Thesaurierend	USD	1.052,74	897,00	984,31
BH - Thesaurierend	JPY	11.687,00	10.683,00	12.306,00

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
B - Thesaurierend	USD	344.297,708	395.396,879	8.370,963	59.470,134
EB - Thesaurierend	USD	5.915,149	6.662,648	1.323,689	2.071,188
UB - Thesaurierend	USD	92.573,696	103.091,712	4.899,878	15.417,894
IB - Thesaurierend	USD	3.000,000	3.000,000	0,000	0,000
BH - Thesaurierend	JPY	136.056,201	364.223,717	9.381,975	237.549,491

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	178.601.578,91
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	398.611,15
Dividenden (Netto)	757.514,45
Bankzinsen	89.003,02
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	873,75
Andere Erträge	67.147,58
	1.313.149,95
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	2.696.988,91
Depotbank- und Depotgebühr	105.623,70
Zentralverwaltungsvergütung	101.398,85
Druck- und Veröffentlichungskosten	7.481,56
Zinsen und Bankspesen	1.029,73
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	101.560,91
"Taxe d'abonnement"	45.064,29
	3.059.147,95
Nettoerträge (-verluste)	-1.745.998,00
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	3.953.897,71
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-3.631.935,91
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-203.060,47
	118.901,33
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.627.096,67
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	22.846.611,53
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-188.919,99
	22.657.691,54
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	21.030.594,87
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	6.196.905,19
Rücknahmen	-43.428.738,67
	-37.231.833,48
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	162.400.340,30

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	42,59
Vereinigte Staaten	31,77
Irland	18,48
Schweiz	1,05
Supranational	1,04
Frankreich	0,79
Niederlande	0,75
Niederländische Antillen	0,61
Deutschland	0,52
Norwegen	0,30
Kanada	0,25
Mexiko	0,24
Italien	0,18
Finnland	0,17
Australien	0,12
Spanien	0,09
Belgien	0,04
Total	98,97

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	60,76
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	10,83
Banken und andere Kreditinstitute	4,19
Länder und Zentralregionen	3,72
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	3,50
Baustoffe und Bauindustrie	1,70
Maschinenbau und Industrieanlagen	1,45
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,30
Supranationale Organisationen	1,19
Fahrzeuge	1,05
Elektrische Geräte und Komponenten	0,89
Verkehr und Transport	0,89
Verschiedene Konsumgüter	0,86
Computerhardware und Netzwerk	0,80
Telekommunikation	0,79
Elektronik und Halbleiter	0,73
Petroleum	0,73
Immobilien	0,68
Energie- und Wasserversorgung	0,65
Grafikverlags- und Druckmedien	0,45
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,41
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,32
Versicherungsgesellschaften	0,29
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,20
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,12
Chemie	0,10
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,10
Einzelhandel und Warenhäuser	0,10
Uhrenindustrie, Schmuck	0,06
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,04
Gesundheits- und Sozialdienste	0,03
Gummi und Reifen	0,02
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,02
Diverse Dienstleistungen	0,01
Verpackungsindustrie	0,00
Total	98,97

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	2.072	96.365,73	0,06
EUR ADIDAS REG	199	44.488,44	0,03
USD ADOBE	1.048	528.820,80	0,33
CHF ALCON INC	623	51.696,80	0,03
USD ALPHABET A	13.982	2.110.303,26	1,30
USD ALPHABET C	12.317	1.875.386,42	1,15
EUR AMADEUS IT GROUP A	554	35.564,14	0,02
USD AMERICAN EXPRESS	3.054	695.365,26	0,43
EUR ASML HOLDING	412	396.993,31	0,24
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	1.290	32.684,47	0,02
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	4.411	1.101.603,14	0,68
EUR AXA	2.280	85.728,46	0,05
CHF BALOISE-HOLDING REG	48	7.530,19	0,00
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	32	3.723,35	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	4	5.813,29	0,00
CHF BKW	22	3.380,50	0,00
EUR BMW	358	41.355,01	0,03
EUR BNP PARIBAS A	1.220	86.777,14	0,05
USD CATERPILLAR	4.586	1.680.447,98	1,03
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	604	92.206,63	0,06
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	827	31.725,04	0,02
USD COCA-COLA	17.811	1.089.676,98	0,67
USD DANAHER	2.605	650.520,60	0,40
EUR DANONE	845	54.655,61	0,03
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	683	30.272,75	0,02
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	240	49.157,28	0,03
EUR DEUTSCHE POST REG	1.410	60.782,56	0,04
CHF DUFFY	104	4.333,46	0,00
USD ELI LILLY & CO	3.362	2.615.551,52	1,61
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	5	3.841,48	0,00
EUR ENEL	9.540	63.045,28	0,04
CHF GEBERIT	39	23.078,86	0,01
CHF GVAUDAN REG	11	49.046,60	0,03
CHF HELVETIA HOLDING LTD	36	4.368,17	0,00
EUR HENKEL PREF	223	17.942,58	0,01
EUR HERMES INTERNATIONAL	35	89.434,80	0,06
USD HOME DEPOT	3.570	1.369.452,00	0,84
EUR IBERDROLA	7.202	89.409,95	0,06
USD IBM	1.946	371.608,16	0,23
EUR ING GROUP	4.210	69.320,51	0,04
USD INTEL	9.571	422.751,07	0,26
USD INTUIT	647	420.550,00	0,26
USD JOHNSON & JOHNSON	8.156	1.290.197,64	0,79
CHF JULIUS BAER GRUPPE	219	12.663,03	0,01
EUR KERING	91	36.004,88	0,02
EUR KERRY GROUP A	209	17.931,20	0,01
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	1.270	38.020,75	0,02
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	71	19.785,84	0,01
CHF LAFARGEHOLCIM REG	570	51.678,12	0,03
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	11.979,65	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	246	22.057,38	0,01
CHF LONZA REG	93	55.777,63	0,03
EUR L'OREAL	294	139.280,15	0,09
EUR LVMH	310	279.122,76	0,17
USD MASTERCARD	4.094	1.971.547,58	1,21
USD MCDONALD'S	2.380	671.041,00	0,41
EUR MERCK	125	22.066,00	0,01
USD MERCK & CO	8.572	1.131.075,40	0,70
USD MICROSOFT	16.813	7.073.565,36	4,36
EUR MUECHENER RUECKVER REG RESTRICTED	173	84.507,73	0,05
EUR NESTE OYJ	504	13.662,43	0,01
CHF NESTLE REG	2.866	304.675,47	0,19
CHF NOVARTIS REG	2.206	213.988,46	0,13
USD NVIDIA	5.875	5.308.415,00	3,27
EUR ORANGE	2.400	28.221,70	0,02
CHF PARTNERS GROUP	22	31.460,17	0,02
USD PROCTER & GAMBLE	8.488	1.377.178,00	0,85
USD PROLOGIS	8.123	1.057.777,06	0,65
EUR REPSOL	1.260	21.010,75	0,01
CHF ROCHE HOLDING	33	8.903,13	0,01
CHF ROCHE HOLDING CERT	724	184.638,42	0,11
USD S&P GLOBAL	1.581	672.636,45	0,41
USD SALESFORCE.COM	2.080	626.454,40	0,39
CHF SANDOZ GROUP LTD	382	11.540,23	0,01
USD SCHLUMBERGER	17.977	985.319,37	0,61
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	848	192.005,86	0,12
USD SEMPRA ENERGY	5.900	423.797,00	0,26
CHF SGS LTD	193	18.749,42	0,01
USD SHERWIN-WILLIAMS	3.769	1.309.086,77	0,81
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	361	8.016,04	0,00
CHF SIKA LTD	165	49.205,37	0,03
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	933	24.999,55	0,02
CHF SONOVA HOLDING REG	63	18.262,91	0,01
EUR STMICROELECTRONICS	703	30.320,25	0,02
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	129	20.624,09	0,01
CHF SWISS LIFE REG	31	21.758,99	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	83	7.837,45	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	347	44.670,70	0,03
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	28	17.141,44	0,01
EUR SYMRISE	412	49.368,31	0,03
USD TESLA MOTORS	9.487	1.667.719,73	1,03
USD TEXAS INSTRUMENTS	2.105	366.712,05	0,23
CHF THE SWATCH GROUP	25	5.812,18	0,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
EUR TOTAL ENERGIES	2.480	169.998,05	0,10
CHF UBS GROUP	3.510	108.102,59	0,07
USD UNION PACIFIC	5.518	1.357.041,74	0,84
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	1.170	35.229,17	0,02
EUR UPM-KYMMENE	1.810	60.344,68	0,04
CHF VAT GROUP	32	16.602,30	0,01
USD VERIZON COMMUNICATIONS	11.985	502.890,60	0,31
USD VISA A	7.107	1.983.421,56	1,22
EUR VONOVIA REG	1.280	37.877,76	0,02
EUR WOLTERS KLUWER	385	60.374,16	0,04
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	168	90.705,01	0,06
Total Aktien		49.030.189,45	30,19
Anleihen			
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	250.000	238.300,00	0,15
USD APPLE INC 4.3%/23-100533	250.000	248.340,00	0,15
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	500.000	475.270,00	0,29
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	100.000	96.365,16	0,06
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	500.000	469.400,00	0,29
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	60.000	57.149,06	0,04
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	240.000	169.931,63	0,10
USD CANADIAN IMPERIAL BANK 0.95%/20-23.10.2025	250.000	234.702,50	0,14
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	500.000	392.050,00	0,24
EUR COÖPERATIEVE RABOBANK UA S. -3221A- 0.25%/19-30.10.2026	100.000	99.840,60	0,06
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	500.000	484.545,00	0,30
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.125%/16-13.04.2026	250.000	237.695,00	0,15
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	500.000	487.910,00	0,30
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.75%/23-140233	250.000	239.807,50	0,15
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	200.000	196.166,88	0,12
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	30.000	27.404,89	0,02
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	500.000	494.365,00	0,30
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	100.000	96.934,32	0,06
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	250.000	249.685,20	0,15
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	500.000	438.100,00	0,27
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	500.000	486.790,00	0,30
USD PEPSICO INC 3.9%/22-180732	250.000	236.780,00	0,15
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	500.000	432.820,00	0,27
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	100.000	67.654,21	0,04
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	200.000	119.859,81	0,07
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	500.000	486.699,22	0,30
USD US 4.5%/06-15.02.2036	750.000	779.648,44	0,48
USD US S. F. 2024 2.25%/14-15.11.2024	500.000	490.957,03	0,30
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	750.000	644.765,63	0,40
USD US TREASURY N/B 1.625%/19-30.11.2026	500.000	464.492,19	0,29
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	500.000	465.117,19	0,29
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	500.000	472.187,50	0,29
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	500.000	457.539,07	0,28
USD US TREASURY N/B S C-2032 2.875%/22-15053	500.000	454.218,75	0,28
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	1.000.000	800.937,50	0,49
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	500.000	478.650,00	0,29
USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037	250.000	252.690,00	0,16
Total Anleihen		13.025.769,28	8,02
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		62.055.958,73	38,21

Investmentfonds

Fondsanteile (Open-End)			
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	4.296	3.532.600,80	2,18
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	64	184.421,82	0,11
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	9.216	2.359.922,69	1,45
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	1.035	1.510.893,82	0,93
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	553	1.493.431,80	0,92
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	1.581	4.146.852,33	2,55
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	12.094	1.835.666,02	1,13
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	86.277	18.161.308,50	11,18
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	16.359	3.212.907,60	1,98
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	48	45.124,36	0,03
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	2.094	2.051.512,74	1,26

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - QBX- USD	13.909	14.815.727,71	9,12
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	3.388	5.453.250,26	3,36
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	3.653	4.691.080,04	2,89
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	1.617	2.675.457,43	1,65
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	1.942	2.415.576,12	1,49
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	3.428	3.269.775,81	2,01
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	750	1.236.911,47	0,76
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	7.077	8.247.323,49	5,08
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	865	1.720.580,15	1,06
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	105	82.979,40	0,05
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	983	1.255.743,18	0,77
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	195	271.189,58	0,17
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	729	958.204,89	0,59
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	682	890.998,90	0,55
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	3.754	3.785.989,09	2,33
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	35.015	3.916.777,90	2,41
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	25.797	4.449.466,56	2,74
Total Fondsanteile (Open-End)		98.671.674,46	60,76
Total Investmentfonds		98.671.674,46	60,76
Total des Wertpapierbestandes		160.727.633,19	98,97
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.851.068,12	1,14
Andere Passiva		-178.361,01	-0,11
Fondsvermögen		162.400.340,30	100,00

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	EUR	951289	LU0091100627	1,30%	1,74%
B - Thesaurierend	EUR	951290	LU0091100890	1,30%	1,74%
CB - Thesaurierend	EUR	52045365	LU2105729961	1,30%	2,43%
EB - Thesaurierend	EUR	28345214	LU1237499444	0,60%	1,01%
IB - Thesaurierend	EUR	1057473	LU0108838904	0,60%	1,04%
UA - Ausschüttend	EUR	26362898	LU1144411714	1,05%	1,49%
UB - Thesaurierend	EUR	26362926	LU1144411805	1,05%	1,49%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	EUR	2,81%	/	6,77%	-13,61%	6,60%
B - Thesaurierend	EUR	2,82%	/	6,77%	-13,61%	6,60%
CB - Thesaurierend	EUR	2,64%	/	6,03%	-14,22%	5,86%
EB - Thesaurierend	EUR	3,00%	/	7,54%	-12,99%	7,36%
IB - Thesaurierend	EUR	2,99%	/	7,52%	-13,01%	7,35%
UA - Ausschüttend	EUR	2,88%	/	7,03%	-13,40%	6,87%
UB - Thesaurierend	EUR	2,88%	/	7,04%	-13,40%	6,86%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
<i>Gegenpartei</i>					
EUR	329.870	CAD	-480.000	10.05.2024	1.853,73
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	96.289.504	USD	-104.040.000	10.05.2024	128.867,45
<i>Merrill Lynch International London - London - United Kingdom</i>					
GBP	750.000	EUR	-876.103	10.05.2024	-222,02
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					130.499,16

Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	349.565.459,77
Bareinlagen bei Banken und Brokern	4.887.206,91
Forderungen aus Erträgen	1.004.690,68
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	130.499,16
	355.587.856,52
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	403.934,59
	403.934,59
Nettovermögen	355.183.921,93

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	EUR	355.183.921,93	440.056.393,63	604.724.604,92
Nettoinventarwert pro Aktie				
A - Ausschüttend	EUR	131,36	122,51	132,21
B - Thesaurierend	EUR	187,75	175,09	188,96
CB - Thesaurierend	EUR	106,25	99,78	108,44
EB - Thesaurierend	EUR	1.141,44	1.056,89	1.132,43
IB - Thesaurierend	EUR	1.325,60	1.227,69	1.315,70
UA - Ausschüttend	EUR	108,50	100,93	108,66
UB - Thesaurierend	EUR	112,99	105,11	113,15

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	EUR	167.125,090	240.222,664	1.892,000	74.989,574
B - Thesaurierend	EUR	1.440.880,766	1.863.834,777	8.640,574	431.594,585
CB - Thesaurierend	EUR	18.727,313	19.875,552	499,385	1.647,624
EB - Thesaurierend	EUR	1.207,262	6.591,113	0,000	5.383,851
IB - Thesaurierend	EUR	10.382,194	10.836,594	0,000	454,400
UA - Ausschüttend	EUR	184.576,101	255.370,544	0,000	70.794,443
UB - Thesaurierend	EUR	226.162,449	344.913,661	8.894,630	127.645,842

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

Für die Periode vom
01.04.2023 bis zum
31.03.2024

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	440.056.393,63
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.160.031,34
Dividenden (Netto)	1.178.468,12
Bankzinsen	122.291,93
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	22.189,81
Andere Erträge	271.067,75
	3.754.048,95
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	4.681.122,31
Depotbank- und Depotgebühr	236.574,24
Zentralverwaltungsvergütung	227.144,24
Druck- und Veröffentlichungskosten	10.417,27
Zinsen und Bankspesen	15,67
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	144.829,42
"Taxe d'abonnement"	95.674,54
	5.395.777,69
Nettoerträge (-verluste)	-1.641.728,74
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	6.423.466,90
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-2.077.926,58
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	353.670,82
	4.699.211,14
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	3.057.482,40
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	23.569.897,34
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-1.117.614,14
	22.452.283,20
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	25.509.765,60
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	2.811.616,00
Rücknahmen	-113.193.853,30
	-110.382.237,30
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	355.183.921,93

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	49,67
Vereinigte Staaten	9,87
Irland	9,02
Deutschland	5,94
Niederlande	5,38
Spanien	4,68
Frankreich	4,14
Italien	2,26
Portugal	1,51
Supranational	1,45
Finnland	1,06
Belgien	0,89
Polen	0,54
Norwegen	0,51
Schweiz	0,43
Österreich	0,42
Mexiko	0,26
Australien	0,16
Kanada	0,11
Niederländische Antillen	0,11
Total	98,42

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	56,78
Länder und Zentralregierungen	13,88
Banken und andere Kreditinstitute	7,67
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	3,25
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,19
Energie- und Wasserversorgung	2,06
Supranationale Organisationen	1,45
Versicherungsgesellschaften	1,11
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,07
Fahrzeuge	1,02
Elektronik und Halbleiter	0,96
Telekommunikation	0,89
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	0,87
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,71
Elektrische Geräte und Komponenten	0,65
Computerhardware und Netzwerk	0,59
Petroleum	0,56
Einzelhandel und Warenhäuser	0,36
Baustoffe und Bauindustrie	0,33
Verkehr und Transport	0,30
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,28
Grafikverlags- und Druckmedien	0,21
Immobilien	0,21
Verschiedene Konsumgüter	0,20
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,16
Chemie	0,14
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,13
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,11
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,08
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,08
Gummi und Reifen	0,07
Uhrenindustrie, Schmuck	0,02
Gesundheits- und Sozialdienste	0,01
Verpackungsindustrie	0,00
Diverse Dienstleistungen	0,00
Total	98,42

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	2.000	86.126,96	0,02
EUR ADIDAS REG	1.680	347.760,00	0,10
USD ADOBE	471	220.061,67	0,06
CHF ALCON INC	603	46.330,73	0,01
USD ALPHABET A	6.258	874.555,50	0,25
USD ALPHABET C	5.520	778.217,78	0,22
EUR AMADEUS IT GROUP A	4.670	277.584,80	0,08
USD AMERICAN EXPRESS	1.372	269.250,63	0,08
EUR ASML HOLDING	3.470	3.095.934,00	0,87
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	10.800	253.368,00	0,07
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	1.969	455.313,02	0,13
EUR AXA	19.200	668.448,00	0,19
CHF BALOISE-HOLDING REG	47	6.827,14	0,00
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	31	3.339,81	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	4	5.362,68	0,00
CHF BKW	22	3.130,10	0,00
EUR BMW	3.010	321.949,60	0,09
EUR BNP PARIBAS A	10.300	678.358,00	0,19
USD CATERPILLAR	2.054	696.895,57	0,20
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	584	82.549,47	0,02
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	6.960	247.219,20	0,07
USD COCA-COLA	7.962	451.032,56	0,13
USD DANAHER	1.164	269.142,67	0,08
EUR DANONE	7.110	425.817,90	0,12
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	5.750	235.980,00	0,07
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	2.020	383.093,00	0,11
EUR DEUTSCHE POST REG	11.900	474.988,50	0,13
CHF DUFFY	100	3.858,13	0,00
USD ELI LILLY & CO	1.505	1.084.101,67	0,31
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	5	3.556,93	0,00
EUR ENEL	80.300	491.355,70	0,14
CHF GEBERIT	38	20.821,38	0,01
CHF GVAUDAN REG	11	45.413,52	0,01
CHF HELVETIA HOLDING LTD	35	4.472,37	0,00
EUR HENKEL PREF	1.880	140.060,00	0,04
EUR HERMES INTERNATIONAL	298	705.068,00	0,20
USD HOME DEPOT	1.600	568.296,30	0,16
EUR IBERDROLA	60.627	696.907,37	0,20
USD IBM	872	154.182,52	0,04
EUR ING GROUP	35.400	539.708,40	0,15
USD INTEL	4.279	175.003,18	0,05
USD INTUIT	289	173.935,19	0,05
CHF JOHNSON & JOHNSON	3.654	535.209,50	0,15
CHF JULIUS BAER GRUPPE	211	11.296,72	0,00
EUR KERING	770	282.089,50	0,08
EUR KERRY GROUP A	1.760	139.814,40	0,04
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	10.700	296.604,00	0,08
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	68	17.546,13	0,00
CHF LAFARGEHOLCIM REG	550	46.171,16	0,01
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	11.092,26	0,00
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	239	19.842,34	0,01
CHF LONZA REG	90	48.979,95	0,01
EUR L'OREAL	2.470	1.083.465,50	0,31
EUR LVMH	2.610	2.175.957,00	0,61
USD MASTERCARD	1.836	818.669,00	0,23
USD MCDONALD'S	1.069	279.078,29	0,08
EUR MERCK	1.050	171.780,00	0,05
USD MERCK & CO	3.853	470.743,84	0,13
USD MICROSOFT	7.536	2.935.690,67	0,83
EUR MUENCHENER RUECKVER REG RESTRICTED	1.450	655.835,00	0,18
EUR NESTE OYJ	4.240	106.424,00	0,03
CHF NESTLE REG	2.770	272.657,41	0,08
CHF NOVARTIS REG	2.130	191.311,33	0,05
USD NVIDIA	2.632	2.202.009,19	0,62
EUR ORANGE	20.200	219.937,60	0,06
CHF PARTNERS GROUP	21	27.805,71	0,01
USD PROCTER & GAMBLE	3.806	571.781,02	0,16
USD PROLOGIS	3.635	438.286,76	0,12
EUR REPSOL	10.600	163.664,00	0,05
CHF ROCHE HOLDING	32	7.993,83	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	700	165.294,27	0,05
USD S&P GLOBAL	706	278.118,24	0,08
USD SALESFORCE.COM	930	259.349,44	0,07
CHF SANDOZ GROUP LTD	369	10.321,76	0,00
USD SCHLUMBERGER	8.038	407.928,50	0,11
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	7.140	1.496.901,00	0,42
USD SEMPRA ENERGY	2.641	175.650,95	0,05
CHF SGS LTD	187	16.820,87	0,00
USD SHERWIN-WILLIAMS	1.685	541.899,12	0,15
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	349	7.175,53	0,00
CHF SIKA LTD	160	44.179,90	0,01
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	7.860	195.006,60	0,05
CHF SONOVA HOLDING REG	61	16.373,27	0,00
EUR STMICROELECTRONICS	5.920	236.415,20	0,07
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	124	18.356,21	0,01
CHF SWISS LIFE REG	30	19.497,30	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	80	6.994,60	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	335	39.931,38	0,01
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	27	15.304,86	0,00
EUR SYMRISE	3.470	384.996,50	0,11
USD TESLA MOTORS	4.241	690.301,29	0,19
USD TEXAS INSTRUMENTS	943	152.111,14	0,04
CHF THE SWATCH GROUP	24	5.166,38	0,00

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

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
EUR TOTAL ENERGIES	20.800	1.320.176,00	0,37
CHF UBS GROUP	3.390	96.672,94	0,03
USD UNION PACIFIC	2.471	562.672,73	0,16
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	9.890	275.733,20	0,08
EUR UPM-KYMMENE	15.200	469.224,00	0,13
CHF VAT GROUP	31	14.892,11	0,00
USD VERIZON COMMUNICATIONS	5.378	208.945,26	0,06
USD VISA A	3.181	821.993,96	0,23
EUR VONOVIA REG	10.800	295.920,00	0,08
EUR WOLTERS KLUWER	3.240	470.448,00	0,13
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	162	80.987,51	0,02
Total Aktien		40.489.900,08	11,40
Anleihen			
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	2.500.000	2.362.225,00	0,67
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	2.000.000	1.765.185,19	0,50
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	2.500.000	2.230.675,00	0,63
EUR AUSTRIA S 1 1.65%/14-21.10.2024	1.500.000	1.484.430,00	0,42
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	750.000	651.944,44	0,18
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	3.000.000	2.779.080,00	0,78
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	2.000.000	1.763.860,00	0,50
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	1.500.000	1.413.225,00	0,40
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	1.500.000	1.305.930,00	0,37
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	3.000.000	2.658.660,00	0,75
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	3.000.000	2.831.610,00	0,80
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17- 18.06.2027	600.000	393.360,25	0,11
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19- 150229	1.000.000	907.370,00	0,26
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20- 01.09.2032	1.250.000	907.523,15	0,26
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA S. -3221A- 0.25%/19-30.10.2026	2.500.000	2.311.125,00	0,65
EUR DAIMLER AG 0.75%/20-10.09.2030	3.000.000	2.611.560,00	0,74
EUR DEUTSCHLAND 2.3%/23-150233	1.000.000	1.004.020,00	0,28
EUR E.ON SE 0.875%/20-200831	3.500.000	2.938.600,00	0,83
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	2.500.000	2.438.400,00	0,69
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20- 13.02.2025	2.000.000	1.794.611,11	0,51
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23- 280728	2.000.000	2.004.780,00	0,56
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18- 13.06.2025	1.500.000	1.355.305,56	0,38
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	1.500.000	1.365.810,00	0,38
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	2.000.000	1.816.360,00	0,51
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	2.000.000	1.852.800,00	0,52
EUR FRANCE OAT 0.5%/15-250525	1.500.000	1.453.365,00	0,41
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	1.000.000	829.250,00	0,23
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	1.000.000	845.830,00	0,24
EUR GERMANY 0.25%/17-150227	2.000.000	1.875.060,00	0,53
EUR GERMANY 1%/14-150824	1.000.000	990.450,00	0,28
EUR IBERDROLA FINANZAS 3.375%/22-221132	3.000.000	2.998.980,00	0,84
EUR IBERDROLA FINANZAS SAU 1.25%/18- 28.10.2026	1.000.000	954.530,00	0,27
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	2.000.000	1.830.981,48	0,52
EUR ING GROEP NV 2.5%/18-15.11.2030	3.000.000	2.843.580,00	0,80
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	1.000.000	934.350,00	0,26
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	3.000.000	2.692.620,00	0,76
EUR IRELAND 1%/16-150526	2.250.000	2.168.505,00	0,61
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	2.000.000	1.849.520,00	0,52
EUR KFW 0.01%/19-05.06.2027	3.000.000	2.756.400,00	0,78
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	2.250.000	1.825.416,67	0,51
EUR KFW 2.75%/23-140233	3.000.000	3.016.260,00	0,85
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15- 11.02.2025	2.000.000	1.802.925,93	0,51
EUR NEDER WATERSCHAPS BANK S. -1414- 1%/15- 03.09.2025	2.000.000	1.936.100,00	0,55
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	2.000.000	1.902.460,00	0,54
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	3.000.000	2.909.070,00	0,82
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	2.500.000	2.461.350,00	0,69
USD PEPSICO INC 3.9%/22-180732	1.000.000	876.962,96	0,25
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	3.000.000	2.606.190,00	0,73
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	2.000.000	1.915.200,00	0,54
EUR SPAIN 1.6%/14-300425	2.000.000	1.963.880,00	0,55
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20- 13.02.2030	1.500.000	1.202.277,78	0,34
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11- 17.11.2026	250.000	156.606,96	0,04
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	750.000	416.179,89	0,12
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	1.000.000	901.294,85	0,25
USD US 4.5%/06-15.02.2036	1.500.000	1.443.793,41	0,41
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	500.000	454.589,84	0,13
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	1.250.000	995.008,69	0,28
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	800.000	689.062,50	0,19
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	2.000.000	1.748.842,59	0,49
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	2.250.000	1.906.412,77	0,54
USD US TREASURY N/B S C-2032 2.875%/22-15053	1.000.000	841.145,83	0,24
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	1.000.000	741.608,80	0,21
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19- 08.02.2029	2.000.000	1.772.777,78	0,50
USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17- 16.03.2037	1.000.000	935.888,89	0,26
Total Anleihen		107.393.177,32	30,24
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		147.883.077,40	41,64

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
Nicht börsennotierte Wertpapiere			
Anleihen			
EUR LEHMAN BROTHERS HOLDINGS FRN 03- 03.11.2008 (MATURED)	1.000.000	4.250,00	0,00
EUR LEHMAN BROTHERS HOLDINGS FRN/04- 21.05.2009	1.000.000	4.250,00	0,00
Total Anleihen		8.500,00	0,00
Nicht börsennotierte Wertpapiere		8.500,00	0,00
Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	11.509	8.762.824,72	2,47
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	153	408.758,62	0,12
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	38.525	9.134.277,50	2,57
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	8.126	10.988.458,74	3,09
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	854	2.135.286,91	0,60
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	1.546	3.754.675,72	1,06
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	290.365	40.807.897,10	11,49
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	83.513	16.277.302,31	4,58
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	1.082	196.763,70	0,06
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	370	319.600,06	0,09
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	14.685	13.321.334,58	3,75
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - QBX- USD	13.693	13.505.228,40	3,80
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	2.067	3.080.553,45	0,87
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	4.923	5.853.683,69	1,65
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	1.664	2.549.280,31	0,72
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX)EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	2.332	2.685.816,22	0,76
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	3.183	2.811.189,01	0,79
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	2.549	3.893.408,69	1,10
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	18.995	20.496.484,40	5,77
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	1.335	2.458.760,97	0,69
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	411	300.745,44	0,08
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	1.785	2.111.357,50	0,59
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	190	244.662,97	0,07
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	4.082	4.967.982,98	1,40
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	8.454	10.226.600,28	2,88
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	9.630	8.991.741,73	2,53
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	87.880	9.102.089,63	2,56
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	14.321	2.287.116,74	0,64
Total Fondsanteile (Open-End)		201.673.882,37	56,78
Total Investmentfonds		201.673.882,37	56,78
Total des Wertpapierbestandes		349.565.459,77	98,42
Bareinlagen bei Banken und Brokern		4.887.206,91	1,38
Andere Nettovermögenswerte		731.255,25	0,20
Fondsvermögen		355.183.921,93	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	672338	LU0078042610	1,30%	1,65%
B - Thesaurierend	CHF	672339	LU0078042883	1,30%	1,65%
IB - Thesaurierend	CHF	1057449	LU0108838490	0,60%	0,95%
UA - Ausschüttend	CHF	26362932	LU1144411987	1,05%	1,40%
UB - Thesaurierend	CHF	26362936	LU1144412019	1,05%	1,40%

Fondsp performance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	CHF	3,89%	/	2,90%	-14,39%	4,99%
B - Thesaurierend	CHF	3,89%	/	2,90%	-14,38%	4,98%
IB - Thesaurierend	CHF	4,07%	/	3,62%	-13,79%	5,71%
UA - Ausschüttend	CHF	3,95%	/	3,15%	-14,17%	5,24%
UB - Thesaurierend	CHF	3,95%	/	3,16%	-14,17%	5,24%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In CHF)
<i>Gegenpartei</i>					
GBP	1.000.000	CHF	-1.085.855	10.05.2024	46.795,00
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	55.252.214	EUR	-59.440.000	10.05.2024	-2.403.804,55
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	197.521.965	USD	-229.650.000	10.05.2024	-8.380.040,31
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	402.448	CAD	-630.000	10.05.2024	-15.167,31
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-10.752.217,17

Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	728.898.753,26
Bareinlagen bei Banken und Brokern	8.605.895,14
Forderungen aus Erträgen	1.664.631,88
	739.169.280,28
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	800.212,00
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	10.752.217,17
	11.552.429,17
Nettovermögen	727.616.851,11

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	CHF	727.616.851,11	851.256.944,84	1.063.871.007,76
Nettoinventarwert pro Aktie				
A - Ausschüttend	CHF	115,08	109,40	119,79
B - Thesaurierend	CHF	174,35	165,74	181,48
IB - Thesaurierend	CHF	1.237,49	1.168,27	1.270,31
UA - Ausschüttend	CHF	103,41	98,07	107,11
UB - Thesaurierend	CHF	106,91	101,38	110,74

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	CHF	800.324,686	1.005.487,488	1.300,697	206.463,499
B - Thesaurierend	CHF	2.124.401,289	2.507.047,167	48.711,449	431.357,327
IB - Thesaurierend	CHF	9.591,977	16.260,205	0,000	6.668,228
UA - Ausschüttend	CHF	1.016.621,508	1.296.921,356	8.800,627	289.100,475
UB - Thesaurierend	CHF	1.385.571,231	1.771.031,053	21.504,065	406.963,887

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	851.256.944,84
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	3.038.263,60
Dividenden (Netto)	2.796.048,99
Bankzinsen	122.079,88
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	15.984,47
Andere Erträge	528.019,15
	6.500.396,09
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	9.097.164,09
Depotbank- und Depotgebühr	473.989,07
Zentralverwaltungsvergütung	454.940,10
Druck- und Veröffentlichungskosten	10.207,76
Zinsen und Bankspesen	202,95
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	148.993,64
"Taxe d'abonnement"	193.270,38
	10.378.767,99
Nettoerträge (-verluste)	-3.878.371,90
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-351.821,43
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	5.697.721,18
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	1.863.435,26
	7.209.335,01
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	3.330.963,11
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	46.469.679,71
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-12.744.204,93
	33.725.474,78
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	37.056.437,89
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	11.280.320,47
Rücknahmen	-171.976.852,09
	-160.696.531,62
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	727.616.851,11

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	49,19
Vereinigte Staaten	11,10
Schweiz	9,43
Irland	5,86
Frankreich	3,53
Supranational	3,33
Niederlande	3,10
Deutschland	2,98
Kanada	2,95
Österreich	1,38
Australien	1,34
Spanien	1,17
Finnland	1,08
Norwegen	0,75
Italien	0,64
Chile	0,53
Vereinigte Arabische Emirate	0,52
Neuseeland	0,40
Schweden	0,28
Belgien	0,24
Niederländische Antillen	0,13
Polen	0,13
Portugal	0,07
Mexiko	0,05
Total	100,18

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	54,63
Banken und andere Kreditinstitute	15,52
Länder und Zentralregierungen	4,42
Supranationale Organisationen	3,87
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	3,38
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,32
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	2,17
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	2,12
Kantone, Bundesländer, Provinzen	2,04
Versicherungsgesellschaften	1,24
Elektrische Geräte und Komponenten	0,94
Baustoffe und Bauindustrie	0,76
Verkehr und Transport	0,73
Telekommunikation	0,72
Computerhardware und Netzwerk	0,66
Chemie	0,61
Energie- und Wasserversorgung	0,55
Uhrenindustrie, Schmuck	0,53
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,41
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,40
Gesundheits- und Sozialdienste	0,28
Elektronik und Halbleiter	0,25
Fahrzeuge	0,23
Petroleum	0,20
Immobilien	0,20
Verschiedene Konsumgüter	0,19
Städte und Gemeinden	0,14
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,12
Grafikverlags- und Druckmedien	0,11
Diverse Dienstleistungen	0,10
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,09
Einzelhandel und Warenhäuser	0,08
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,08
Verpackungsindustrie	0,04
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,02
Gummi und Reifen	0,01
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,01
Total	100,18

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	91.086	3.815.592,54	0,52
EUR ADIDAS REG	586	117.996,52	0,02
USD ADOBE	1.118	508.120,29	0,07
CHF ALCON INC	27.380	2.046.381,20	0,28
USD ALPHABET A	14.763	2.006.908,98	0,28
USD ALPHABET C	13.064	1.791.593,51	0,25
EUR AMADEUS IT GROUP A	1.630	94.247,02	0,01
USD AMERICAN EXPRESS	3.239	664.251,26	0,09
EUR ASML HOLDING	1.210	1.050.143,94	0,14
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	3.790	86.490,51	0,01
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	4.671	1.050.682,08	0,14
AXA	6.730	227.920,14	0,03
CHF BALOISE-HOLDING REG	2.136	301.816,80	0,04
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	1.398	146.510,40	0,02
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	185	242.165,00	0,03
CHF BKW	1.009	139.645,60	0,02
EUR BMW	1.050	109.247,61	0,02
EUR BNP PARIBAS A	3.600	230.635,13	0,03
USD CATERPILLAR	4.859	1.603.671,48	0,22
CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI	5	544.000,00	0,07
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	26.607	3.658.462,50	0,50
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	2.440	84.307,08	0,01
USD COCA-COLA	18.790	1.035.413,29	0,14
USD DANAHER	2.756	619.883,42	0,09
EUR DANONE	2.490	145.062,41	0,02
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	2.010	80.242,54	0,01
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	707	130.428,80	0,02
EUR DEUTSCHE POST REG	4.150	161.133,36	0,02
CHF DUFFY	4.573	171.624,69	0,02
USD ELI LILLY & CO	3.561	2.495.207,83	0,34
CHF ENS-CHEMIE HOLDING	243	168.156,00	0,02
EUR ENEL	28.100	162.258,43	0,02
CHF GEBERIT	1.747	931.151,00	0,13
CHF GIVAUDAN REG	483	1.939.728,00	0,27
CHF HELVETIA HOLDING LTD	1.582	196.642,60	0,03
EUR HENKEL PREF	658	47.685,18	0,01
EUR HERMES INTERNATIONAL	104	239.358,76	0,03
USD HOME DEPOT	3.785	1.307.741,68	0,18
EUR IBERDROLA	21.158	236.583,70	0,03
USD IBM	2.087	355.517,00	0,05
EUR ING GROUP	12.400	183.898,78	0,03
USD INTEL	10.111	402.252,72	0,06
USD INTUIT	686	401.619,65	0,06
JOHNSON & JOHNSON	8.635	1.230.322,18	0,17
CHF JULIUS BAER GRUPPE	9.603	500.124,24	0,07
EUR KERING	270	96.219,08	0,01
EUR KERRY GROUP A	617	47.678,84	0,01
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	3.730	100.578,07	0,01
CHF KUEHNE & NAGEL-INTERNATIONAL	3.087	774.837,00	0,11
CHF LAFARGEHOLCIM REG	25.053	2.045.827,98	0,28
CHF LINDT & SPRUENGLI	45	485.550,00	0,07
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	10.876	878.345,76	0,12
CHF LONZA REG	4.087	2.207.797,40	0,30
EUR L'OREAL	866	369.519,42	0,05
EUR LVMH	912	739.615,29	0,10
USD MASTERCARD	4.331	1.878.560,09	0,26
USD MCDONALD'S	2.523	640.717,86	0,09
EUR MERCK	368	58.564,22	0,01
EUR MERCK & CO	9.127	1.084.713,21	0,15
USD MICROSOFT	17.806	6.747.408,61	0,93
EUR MUECHENER RUECKVER REG RESTRICTED	508	223.507,21	0,03
EUR NESTE OYJ	1.480	36.135,72	0,00
CHF NESTLE REG	126.239	12.087.384,25	1,66
CHF NOVARTIS REG	97.009	8.475.676,33	1,16
USD NVIDIA	6.219	5.061.217,93	0,70
EUR ORANGE	7.080	74.966,42	0,01
EUR PARTNERS GROUP	963	1.240.344,00	0,17
USD PROCTER & GAMBLE	9.037	1.320.646,16	0,18
USD PROLOGIS	8.599	1.008.563,21	0,14
EUR REPSOL	3.710	55.721,45	0,01
CHF ROCHE HOLDING	1.447	351.621,00	0,05
CHF ROCHE HOLDING CERT	31.851	7.316.174,70	1,01
USD S&P GLOBAL	1.673	641.094,36	0,09
USD SALESFORCE.COM	2.201	597.067,81	0,08
CHF SANDOZ GROUP LTD	16.799	457.100,79	0,06
EUR SCHLUMBERGER	18.970	936.493,18	0,13
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	2.500	509.842,59	0,07
USD SEMPRA ENERGY	6.245	404.032,03	0,06
CHF SGS LTD	8.486	742.525,00	0,10
USD SHERWIN-WILLIAMS	3.990	1.248.224,42	0,17
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	15.829	316.580,00	0,04
CHF SIKA LTD	7.263	1.950.841,80	0,27
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	2.750	66.368,30	0,01
CHF SONOVA HOLDING REG	2.776	724.813,60	0,10
EUR STMICROELECTRONICS	2.070	80.412,82	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	5.651	813.744,00	0,11
CHF SWISS LIFE REG	1.368	864.849,60	0,12
CHF SWISS PRIME SITE	3.661	311.368,05	0,04
CHF SWISS REINSURANCE	15.245	1.767.657,75	0,24
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	1.223	674.362,20	0,09
EUR SYMRISE	1.210	130.591,20	0,02
USD TESLA MOTORS	10.021	1.596.655,76	0,22
USD TEXAS INSTRUMENTS	2.228	349.595,43	0,05

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 Nettvermö gens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettvermö gens
CHF THE SWATCH GROUP	1.087	227.617,80	0,03	USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	1.000.000	890.543,62	0,12
EUR TOTAL ENERGIES	7.290	450.087,83	0,06	CHF INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC	800.000	794.080,00	0,11
CHF UBS GROUP	154.400	4.283.056,00	0,59	0.25%/19-30.09.2024			
USD UNION PACIFIC	5.843	1.294.269,99	0,18	EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	2.000.000	1.746.164,07	0,24
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	3.460	93.836,13	0,01	USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	2.000.000	1.713.517,14	0,24
EUR UPM-KYMMENE	5.320	159.753,18	0,02	EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	1.000.000	899.560,29	0,12
CHF VAT GROUP	1.417	662.164,10	0,09	EUR KFW 0.01%/19-05.05.2027	1.000.000	893.762,70	0,12
USD VERIZON COMMUNICATIONS	12.706	480.199,62	0,07	USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	4.000.000	3.156.753,89	0,43
USD VISA A	7.525	1.891.527,69	0,26	EUR KFW 2.75%/23-140233	2.000.000	1.956.044,61	0,27
EUR VONOVIA REG	3.770	100.483,13	0,01	USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	2.000.000	1.753.796,19	0,24
EUR WOLTERS KLUWER	1.130	159.604,93	0,02	CHF MANITOBA (PROVINCE OF) 0.25%/19-15.03.2029	2.000.000	1.904.000,00	0,26
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	7.370	3.584.031,00	0,49	CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027	1.000.000	955.000,00	0,13
Total Aktien		117.636.599,15	16,17	CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG	5.000.000	4.687.500,00	0,64
Anleihen				0.25%/20-18.09.2028			
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	5.000.000	5.125.000,00	0,70	CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.1%/20-17.12.2025	3.000.000	2.922.000,00	0,40
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	1.000.000	919.141,75	0,13	CHF MUENCHNR HYPOTKBNK SUB 4.2525%/23-070633	1.000.000	1.062.000,00	0,15
CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025	1.000.000	981.000,00	0,13	CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	1.500.000	1.509.000,00	0,21
CHF APPLE 0.375%/15-25.11.2024	1.000.000	993.400,00	0,14	CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.3%/17-31.10.2025	2.000.000	1.965.000,00	0,27
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	2.500.000	2.146.354,86	0,29	CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.125%/19-21.06.2027	5.000.000	4.802.500,00	0,66
EUR ASIAN DEVELOPMENT BANK 0%/19-24.10.2029	2.000.000	1.679.686,34	0,23	EUR NEDER WATERSCHAPSBAK S. -1414- 1%/15-03.09.2025	1.500.000	1.412.505,96	0,19
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	2.000.000	1.735.911,29	0,24	EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	750.000	693.981,74	0,10
CHF AUCLAND COUNCIL 1.66%/22-181027	1.000.000	1.012.000,00	0,14	CHF NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025	400.000	396.200,00	0,05
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	1.000.000	925.094,98	0,13	CHF NORDEA BANK ABP 0.125%/20-02.06.2026	3.440.000	3.341.960,00	0,46
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	2.500.000	2.113.929,86	0,29	CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028	6.000.000	5.682.000,00	0,78
CHF BANCO BILBAO SA 2.4075%/22-281125	3.000.000	3.040.500,00	0,42	CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025	4.000.000	3.950.400,00	0,54
CHF BANCO DE CREDITO E 0.5994%/22-260427	4.000.000	3.828.000,00	0,53	EUR OBRIGACOE'S DO TESOURO 144A 1.95%/150629	250.000	235.816,49	0,03
CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	1.750.000	1.665.125,00	0,23	EUR OBRIGACOE'S DO TESOURO 2.125%/18-171028	250.000	239.427,82	0,03
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	1.000.000	901.116,69	0,12	CHF OEKB 2.625%/06-22.11.2024	3.000.000	3.024.000,00	0,42
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.1425%/21-251028	1.000.000	937.000,00	0,13	CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.05%/21-120533	1.000.000	891.000,00	0,12
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.2%/20-03.11.2028	4.400.000	4.118.400,00	0,57	CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.25%/17-28.06.2029	2.000.000	1.897.000,00	0,26
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027	2.000.000	1.940.000,00	0,27	USD PEPISCO INC 3.9%/22-180732	1.000.000	853.065,72	0,12
CHF BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.25%/19-24.10.2029	1.000.000	922.500,00	0,13	CHF PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	1.500.000	1.267.585,66	0,17
CHF BAWAG P.S.K. 2.955%/22-291127	5.000.000	5.172.500,00	0,71	CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029	750.000	714.375,00	0,10
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	1.000.000	857.897,41	0,12	CHF PROVINCE OF QUEBEC 2.04%/23-090533	7.000.000	7.420.000,00	1,02
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	1.000.000	916.476,41	0,13	CHF QUEBEC 0.75%/14-21.11.2024	1.100.000	1.095.270,00	0,15
CHF BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028	1.000.000	937.000,00	0,13	EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	1.000.000	931.505,40	0,13
CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	1.000.000	979.500,00	0,13	CHF ROYAL BANK OF CANADA 0.2%/21-220931	2.000.000	1.778.000,00	0,24
CHF BNG 1.25%/14-30.04.2024	1.000.000	999.700,00	0,14	CHF SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 0.15%/19-10.12.2024	700.000	693.210,00	0,10
CHF BNG BANK 3.25%/07-290637	500.000	621.500,00	0,09	CHF SOCIETE NATIONALE SNCF 1.5825%/24-070239	3.000.000	3.057.000,00	0,42
EUR BNP PARIBAS 1.125%/19-280824	1.000.000	962.273,48	0,13	EUR SPAIN 1.6%/14-300425	500.000	477.591,07	0,07
CHF BNP PARIBAS SA S.19447 0.1475%/21-130727	1.000.000	952.500,00	0,13	CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 2.7%/23-200329	3.600.000	3.704.400,00	0,51
CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LB) 11%/20-24.07.2028	1.355.000	1.270.990,00	0,17	CHF SWEDBANK AB 2.7725%/23-130628	1.000.000	1.035.000,00	0,14
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	1.000.000	862.070,51	0,12	USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	1.500.000	1.169.515,71	0,16
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	500.000	459.074,77	0,06	CHF TRANSPOWER NEW ZEALAND LIMITED 0.02%/19-16.12.2027	690.000	657.915,00	0,09
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	1.500.000	956.602,95	0,13	AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	1.500.000	914.036,55	0,13
CHF CANADIAN IMP BK OF COM 0.18%/21-200429	1.000.000	931.500,00	0,13	AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	2.000.000	1.079.570,64	0,15
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	1.000.000	962.500,00	0,13	CHF UBS GROUP FUNDING T. 2 1.25%/16-23.02.2026	600.000	595.200,00	0,08
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025	2.000.000	1.956.000,00	0,27	USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	2.000.000	1.753.469,13	0,24
CHF CENTRAL AMER BANK 0.11%/21-151228	5.000.000	4.630.000,00	0,64	USD US 4.5%/06-15.02.2036	3.000.000	2.809.900,07	0,39
CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028	3.000.000	2.847.000,00	0,39	USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	1.500.000	1.326.606,81	0,18
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	500.000	353.117,26	0,05	USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	2.000.000	1.548.631,51	0,21
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	1.000.000	975.000,00	0,13	USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	2.000.000	1.675.713,88	0,23
CHF COOPERATIVE RABOBANK UA 0.25%/19-25.11.2027	5.000.000	4.745.000,00	0,65	USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	4.000.000	3.402.373,26	0,47
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	3.400.000	3.537.700,00	0,49	USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	5.000.000	4.121.028,94	0,57
CHF CORPORACION ANDINA 0.45%/22-240227	2.500.000	2.402.500,00	0,33	USD US TREASURY N/B S C-2032 2.875%/22-15053	650.000	531.846,00	0,07
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.25%/17-27.07.2027	1.250.000	1.204.375,00	0,17	USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	4.000.000	2.885.599,83	0,40
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026	2.000.000	1.951.000,00	0,27	USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	2.500.000	2.155.586,98	0,30
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.25%/19-24.10.2029	1.000.000	940.000,00	0,13	USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037	2.000.000	1.820.771,83	0,25
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.1637%/21-280428	1.500.000	1.412.250,00	0,19	Total Anleihen	213.729.253,26	29,37	
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.25%/19-10.10.2029	3.000.000	2.775.000,00	0,38	Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere	331.365.852,41	45,54	
CHF DEUTSCHE BAHN FIN 1.885%/23-130935	3.000.000	3.172.500,00	0,44	Investmentfonds			
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.5%/18-18.07.2028	1.900.000	1.840.150,00	0,25	Fondsanteile (Open-End)			
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	2.000.000	1.897.562,88	0,26	USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	24.661	18.264.948,73	2,51
CHF EIB 1.46%/23-180733	600.000	618.900,00	0,09	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	309	803.612,75	0,11
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	2.000.000	1.745.707,96	0,24	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	20.229	4.665.596,84	0,64
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	2.500.000	1.957.614,34	0,27	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	17.578	23.122.323,80	3,18
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-280728	3.000.000	2.925.224,62	0,40	USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	2.236	5.439.201,95	0,75
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.000.000	878.915,65	0,12	USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	3.064	7.238.572,78	0,99
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	750.000	664.295,84	0,09				
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	2.000.000	1.766.864,19	0,24				
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	4.000.000	3.788.000,00	0,52				
EUR FRANCE OAT 0.5%/15-250525	1.000.000	942.507,20	0,13				
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	1.000.000	806.652,94	0,11				
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	500.000	411.390,57	0,06				
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029	1.010.000	908.495,00	0,12				

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	175.427	23.982.675,17	3,30
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	93.397	17.707.714,48	2,43
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	2.206	390.233,43	0,05
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -OBX USD- USD	624	523.614,31	0,07
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -OBX USD- USD	31.503	27.798.856,91	3,82
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - OBX- USD	29.120	27.938.040,03	3,84
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -OBX EUR ACC- EUR	2.160	3.131.434,00	0,43
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -OBX- JPY	8.862	10.250.201,45	1,41
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -OBX GBP ACC- GBP	2.497	3.721.208,90	0,51
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -OBX USD ACC- USD	3.314	3.712.799,44	0,51
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -OBX CAD ACC- CAD	6.895	5.923.643,56	0,81
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	5.440	8.082.771,42	1,11
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	60.564	63.570.535,33	8,74
CHF CS INVESTMENT FUNDS 14 - CREDIT SUISSE (LUX) SWISS FRANC BOND FUND -EB-	413.230	49.637.187,60	6,82
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	2.469	4.423.411,83	0,61
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	602	428.504,08	0,06
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	4.089	4.704.808,00	0,65
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	5.035	6.306.891,35	0,87
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	9.597	11.361.713,49	1,56
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	18.775	22.092.772,62	3,04
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	21.480	19.510.087,47	2,68
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	188.070	18.948.368,56	2,60
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	24.790	3.851.170,57	0,53
Total Fondsanteile (Open-End)		397.532.900,85	54,63
Total Investmentfonds		397.532.900,85	54,63
Total des Wertpapierbestandes		728.898.753,26	100,18
Bareinlagen bei Banken und Brokern		8.605.895,14	1,18
Andere Passiva		-9.887.797,29	-1,36
Fondsvermögen		727.616.851,11	100,00

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

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Ausschüttend	USD	672336	LU0078046876	1,30%	1,70%
B - Thesaurierend	USD	672337	LU0078046959	1,30%	1,68%
EB - Thesaurierend	USD	28145654	LU1230137199	0,60%	0,97%
IB - Thesaurierend	USD	28234308	LU1230137439	0,60%	0,99%
UA - Ausschüttend	USD	26362951	LU1144412100	1,05%	1,44%
UB - Thesaurierend	USD	26364579	LU1144412282	1,05%	1,44%
BH - Thesaurierend	JPY	36829010	LU1614284344	1,30%	1,81%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2023	2022	2021
A - Ausschüttend	USD	2,60%	/	9,36%	-14,34%	5,01%
B - Thesaurierend	USD	2,60%	/	9,35%	-14,34%	5,01%
EB - Thesaurierend	USD	2,78%	/	10,14%	-13,72%	5,77%
IB - Thesaurierend	USD	2,78%	/	10,12%	-13,74%	5,75%
UA - Ausschüttend	USD	2,66%	/	9,62%	-14,12%	5,27%
UB - Thesaurierend	USD	2,66%	/	9,63%	-14,12%	5,27%
BH - Thesaurierend	JPY	1,17%	/	3,05%	-16,45%	4,50%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
JPY	128.591.200	USD	-872.960	09.04.2024	-21.750,87
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	1.167.600	USD	-7.730	09.04.2024	-1,29
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
JPY	129.758.800	USD	-860.911	23.04.2024	-139,31
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
EUR	140.000	USD	-151.782	10.05.2024	-310,52
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
GBP	240.000	USD	-302.913	10.05.2024	334,56
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	259.874	CAD	-350.000	10.05.2024	1.094,99
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	18.130.488	EUR	-16.780.000	10.05.2024	-24.371,19
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-45.143,63

Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung

	31.03.2024
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	256.806.396,03
Bareinlagen bei Banken und Brokern	3.531.421,18
Forderungen aus Erträgen	648.391,69
	260.986.208,90
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	276.547,67
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	45.143,63
	321.691,30
Nettovermögen	260.664.517,60

Fondsentwicklung		31.03.2024	31.03.2023	31.03.2022
Fondsvermögen	USD	260.664.517,60	285.994.381,30	402.188.276,98
Nettoinventarwert pro Aktie				
A - Ausschüttend	USD	168,01	154,69	165,85
B - Thesaurierend	USD	308,65	284,18	304,69
EB - Thesaurierend	USD	1.324,67	1.210,94	1.289,04
IB - Thesaurierend	USD	1.316,15	1.203,38	1.281,24
UA - Ausschüttend	USD	121,53	111,62	119,38
UB - Thesaurierend	USD	127,14	116,77	124,89
BH - Thesaurierend	JPY	9.963,00	9.741,00	10.833,00

Anzahl der Anteile im Umlauf		am Ende des Geschäftsjahres	zu Beginn des Geschäftsjahres	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile
A - Ausschüttend	USD	71.509,335	114.127,910	646,364	43.264,939
B - Thesaurierend	USD	531.943,054	576.052,825	50.680,687	94.790,458
EB - Thesaurierend	USD	4.877,562	5.806,580	984,264	1.913,282
IB - Thesaurierend	USD	27.430,685	34.914,687	0,000	7.484,002
UA - Ausschüttend	USD	107.516,846	148.652,484	210,000	41.345,638
UB - Thesaurierend	USD	213.191,981	286.095,798	187,970	73.091,787
BH - Thesaurierend	JPY	26.235,086	76.400,289	0,000	50.165,203

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

Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	285.994.381,30
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.868.430,43
Dividenden (Netto)	651.005,64
Bankzinsen	138.569,25
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	9.966,80
Andere Erträge	183.886,98
	2.851.859,10
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	2.992.347,19
Depotbank- und Depotgebühr	164.681,97
Zentralverwaltungsvergütung	158.162,60
Druck- und Veröffentlichungskosten	10.421,82
Zinsen und Bankspesen	1,49
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	113.597,64
"Taxe d'abonnement"	62.602,57
	3.501.815,28
Nettoerträge (-verluste)	-649.956,18
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	2.642.646,26
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-651.143,12
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-103.760,07
	1.887.743,07
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	1.237.786,89
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	19.603.741,97
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	109.018,05
	19.712.760,02
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	20.950.546,91
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	16.430.788,92
Rücknahmen	-62.711.199,53
	-46.280.410,61
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	260.664.517,60

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Geographische Aufteilung

Luxemburg	51,72
Vereinigte Staaten	25,81
Irland	10,29
Supranational	4,17
Niederlande	1,31
Norwegen	0,93
Deutschland	0,88
Mexiko	0,75
Frankreich	0,59
Schweiz	0,46
Italien	0,30
Finnland	0,28
Niederländische Antillen	0,23
Australien	0,18
Belgien	0,18
Spanien	0,14
Kanada	0,11
Österreich	0,10
Polen	0,08
Total	98,52

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	61,24
Länder und Zentralregionen	11,40
Supranationale Organisationen	4,53
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	4,09
Banken und andere Kreditinstitute	3,90
Computerhardware und Netzwerk	1,87
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,84
Telekommunikation	1,82
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,35
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,95
Energie- und Wasserversorgung	0,86
Baustoffe und Bauindustrie	0,64
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,55
Verkehr und Transport	0,52
Fahrzeuge	0,40
Elektrische Geräte und Komponenten	0,35
Verschiedene Konsumgüter	0,33
Elektronik und Halbleiter	0,29
Petroleum	0,28
Immobilien	0,26
Versicherungsgesellschaften	0,19
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,18
Grafikverlags- und Druckmedien	0,17
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,16
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,11
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,09
Einzelhandel und Warenhäuser	0,05
Chemie	0,04
Uhrenindustrie, Schmuck	0,03
Forstwirtschaft, Papier und Forstprodukte	0,02
Gummi und Reifen	0,01
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,01
Gesundheits- und Sozialdienste	0,01
Verpackungsindustrie	0,00
Diverse Dienstleistungen	0,00
Total	98,52

Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Aktien			
CHF ABB REG	1.440	66.972,32	0,03
EUR ADIDAS REG	139	31.074,84	0,01
USD ADOBE	637	321.430,20	0,12
CHF ALCON INC	434	36.013,50	0,01
USD ALPHABET A	8.475	1.279.131,75	0,49
USD ALPHABET C	7.466	1.136.773,16	0,44
EUR AMADEUS IT GROUP A	387	24.843,54	0,01
USD AMERICAN EXPRESS	1.852	421.681,88	0,16
EUR ASML HOLDING	288	277.509,89	0,11
EUR ASSICURAZIONI GENERALI	288	22.777,78	0,01
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	2.667	666.055,58	0,26
EUR AXA	1.600	60.160,32	0,02
CHF BALOISE-HOLDING REG	34	5.333,44	0,00
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	22	2.559,80	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	4	5.613,29	0,00
CHF BKW	16	2.458,55	0,00
EUR BMW	250	28.879,20	0,01
EUR BNP PARIBAS A	854	60.744,00	0,02
USD CATERPILLAR	2.779	1.019.308,97	0,39
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	420	64.117,19	0,02
EUR CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	578	22.173,00	0,01
USD COCA-COLA	10.746	657.440,28	0,25
USD DANAHER	1.574	393.059,28	0,15
EUR DANONE	591	38.226,59	0,01
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	477	21.142,17	0,01
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	168	34.410,10	0,01
EUR DEUTSCHE POST REG	985	42.461,58	0,02
CHF DUFFY	72	3.000,09	0,00
USD ELI LILLY & CO	2.038	1.585.482,48	0,61
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	4	3.073,18	0,00
EUR ENEL	6.670	44.078,88	0,02
CHF GEBERIT	28	16.569,44	0,01
CHF GVAUDAN REG	8	35.670,25	0,01
CHF HELVETIA HOLDING LTD	25	3.450,12	0,00
EUR HENKEL PREF	156	12.551,76	0,00
EUR HERMES INTERNATIONAL	25	63.882,00	0,02
USD HOME DEPOT	2.167	831.261,20	0,32
USD IBERDROLA	5.035	62.507,52	0,02
USD IBM	1.176	224.568,96	0,09
EUR ING GROUP	2.940	48.409,10	0,02
USD INTEL	5.789	255.700,13	0,10
USD INTUIT	392	254.800,00	0,10
USD JOHNSON & JOHNSON	4.938	781.142,22	0,30
CHF JULIUS BAER GRUPPE	152	8.788,95	0,00
EUR KERING	64	25.322,11	0,01
EUR KERRY GROUP A	146	12.526,10	0,00
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	886	26.524,71	0,01
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	49	13.655,02	0,01
CHF LAFARGEHOLCIM REG	396	35.902,70	0,01
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	11.979,65	0,00
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	172	15.422,23	0,01
EUR LONZA REG	65	38.984,36	0,01
EUR L'OREAL	205	97.117,11	0,04
EUR LVMH	216	194.485,54	0,07
USD MASTERCARD	2.482	1.195.256,74	0,46
USD MCDONALD'S	1.445	407.417,75	0,16
EUR MERCK	87	15.371,86	0,01
USD MERCK & CO	5.215	688.119,25	0,26
USD MICROSOFT	10.188	4.289.285,36	1,64
EUR MUENCHENER RUECKVER REG RESTRICTED	121	59.106,56	0,02
EUR NESTE OYJ	352	9.542,02	0,00
CHF NESTLE REG	2.000	212.613,72	0,08
CHF NOVARTIS REG	1.540	149.384,51	0,06
USD NVIDIA	3.556	3.213.069,36	1,23
EUR ORANGE	1.680	19.755,19	0,01
CHF PARTNERS GROUP	15	21.450,12	0,01
USD PROCTER & GAMBLE	5.150	835.587,50	0,32
USD PROLOGIS	4.927	641.593,94	0,25
EUR REPSOL	880	14.674,18	0,01
CHF ROCHE HOLDING	23	6.205,21	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	504	128.532,82	0,05
USD S&P GLOBAL	954	405.879,30	0,16
USD SALESFORCE.COM	1.258	378.884,44	0,15
CHF SANDOZ GROUP LTD	266	8.035,87	0,00
USD SCHLUMBERGER	10.837	593.975,97	0,23
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	592	134.041,82	0,05
USD SEMPRA ENERGY	3.575	256.792,25	0,10
CHF SGS LTD	134	13.017,73	0,00
USD SHERWIN-WILLIAMS	2.278	791.217,74	0,30
CHF SIG COMBIBLOC SERVICES	251	5.573,48	0,00
CHF SIKA LTD	115	34.294,65	0,01
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	652	17.470,21	0,01
CHF SONOVA HOLDING REG	44	12.755,05	0,00
EUR STMICROELECTRONICS	491	21.176,74	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	90	14.388,90	0,01
CHF SWISS LIFE REG	22	15.441,86	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	58	5.476,77	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	241	31.024,89	0,01
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	19	11.631,69	0,00
EUR SYMRISE	288	34.509,89	0,01
USD TESLA MOTORS	5.742	1.009.386,18	0,39
USD TEXAS INSTRUMENTS	1.278	222.640,38	0,09
CHF THE SWATCH GROUP	17	3.952,28	0,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
EUR TOTAL ENERGIES	1.730	118.587,35	0,05	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SO EURO CORPORATE	69.130	10.492.772,62	4,03
CHF UBS GROUP	2.440	75.148,24	0,03	BOND FUND -EB- EUR			
USD UNION PACIFIC	3.343	822.143,99	0,32	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG	83.618	17.601.589,00	6,75
EUR UNIVERSAL MUSIC GROUP INC	821	24.720,64	0,01	LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			
EUR UPM-KYMMENE	1.260	42.007,90	0,02	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD	1.485	291.654,00	0,11
CHF VAT GROUP	22	11.414,08	0,00	ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			
USD VERIZON COMMUNICATIONS	7.280	305.468,80	0,12	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	178	166.319,04	0,06
USD VISA A	4.307	1.201.997,56	0,46	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
EUR VONOVIA REG	895	26.484,84	0,01	LOCAL -QBX USD- USD			
EUR WOLTERS KLUWER	269	42.183,50	0,02	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	10.394	10.183.105,74	3,91
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	117	63.170,26	0,02	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS			
Total Aktien		30.107.270,74	11,55	USD -QBX USD- USD			
Anleihen				USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	9.108	9.701.750,52	3,72
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	2.500.000	2.383.000,00	0,91	(LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -			
USD APPLE INC 4.3%/23-100533	2.000.000	1.986.720,00	0,76	QBX- USD			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	2.000.000	1.901.080,00	0,73	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	1.706	2.745.940,07	1,05
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED)	250.000	240.912,90	0,09	(LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR			
2.124%/19-01.10.2030				ACC- EUR			
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	250.000	256.772,70	0,10	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	2.791	3.584.123,84	1,37
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	2.000.000	1.877.600,00	0,72	(LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY			
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	500.000	476.242,20	0,18	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	786	1.300.500,64	0,50
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	400.000	283.219,38	0,11	(LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP			
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	2.500.000	1.960.250,00	0,75	ACC- GBP			
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	1.000.000	969.090,00	0,37	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF	1.103	1.371.977,58	0,53
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	2.000.000	1.738.760,00	0,67	(LUX)EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.125%/16-13.04.2026	1.000.000	950.780,00	0,36	USD ACC- USD			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	2.000.000	1.951.640,00	0,75	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV -	2.125	2.026.917,62	0,78
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.75%/23-140233	2.000.000	1.918.460,00	0,74	CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX			
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	500.000	467.650,80	0,18	CAD ACC- CAD			
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	200.000	196.676,64	0,08	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX)	1.657	2.733.420,34	1,05
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	500.000	490.417,20	0,19	GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND			
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	300.000	300.153,60	0,12	EB USD			
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	200.000	179.118,00	0,07	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT	40.184	46.829.228,08	17,97
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	200.000	182.699,28	0,07	SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -			
EUR GERMANY 1%/14-150824	250.000	267.421,50	0,10	EB- USD	872	1.734.503,92	0,67
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	2.500.000	2.471.825,00	0,95	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	239	188.876,92	0,07
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	500.000	504.549,00	0,19	SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP			
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	500.000	484.671,60	0,19	USD -USD			
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	2.500.000	2.378.050,00	0,91	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	1.269	1.621.096,74	0,62
EUR IRELAND 1%/16-150526	100.000	104.088,24	0,04	SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY			
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	750.000	749.055,60	0,29	FUND -EBP USD ACC- USD			
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	2.000.000	1.752.400,00	0,67	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	136	189.137,35	0,07
USD KOMMUNALBANKEN AG S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	2.500.000	2.433.950,00	0,93	SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY			
USD PEPSICO INC 3.9%/22-180732	2.000.000	1.894.240,00	0,73	FUND -EB- CHF			
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	200.000	187.645,68	0,07	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	2.798	3.677.719,18	1,41
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	200.000	206.841,60	0,08	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE			
EUR SPAIN 2.75%/14-311024	250.000	268.552,80	0,10	BOND FUND -EB- USD			
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	2.000.000	1.731.280,00	0,66	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	5.377	7.024.781,65	2,69
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	500.000	338.271,04	0,13	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE			
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	218.000	130.647,19	0,05	INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD			
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	2.500.000	2.433.496,10	0,93	USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT	6.826	6.883.172,08	2,64
USD US 4.5%/06-15.02.2036	3.000.000	3.118.593,75	1,20	SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES			
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	2.000.000	1.963.828,12	0,75	FUND -EA- USD			
USD US TREASURY 1.625%/16-150526	2.000.000	1.880.000,00	0,72	USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	59.625	6.669.652,50	2,56
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	2.000.000	1.719.375,00	0,66	USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	8.043	1.387.256,64	0,53
USD US TREASURY N/B 1.625%/19-30.11.2026	2.000.000	1.857.968,76	0,71	Total Fondsanteile (Open-End)		159.634.603,77	61,24
USD US TREASURY N/B 1.875%/19-31.07.2026	2.000.000	1.882.500,00	0,72	Total Investmentfonds		159.634.603,77	61,24
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	2.500.000	2.325.585,95	0,89	Total des Wertpapierbestandes		256.806.396,03	98,52
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	2.000.000	1.888.750,00	0,72	Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.531.421,18	1,35
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	3.000.000	2.745.234,39	1,05	Andere Nettovermögenswerte		326.700,39	0,13
USD US TREASURY N/B S C-2032 2.875%/22-15053	2.000.000	1.816.875,00	0,70	Fondsvermögen		260.664.517,60	100,00
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	3.000.000	2.402.812,50	0,92				
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	2.500.000	2.393.250,00	0,92				
USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037	2.000.000	2.021.520,00	0,78				
Total Anleihen		67.064.521,52	25,73				
Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		97.171.792,26	37,28				
Investmentfonds							
Fondsanteile (Open-End)							
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION	7.860	6.463.278,00	2,48				
FUND -EB- USD							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND	123	355.964,91	0,14				
PLUS EQUITY FUND EB EUR							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY	9.070	2.322.536,76	0,89				
GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR							
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD	5.354	7.818.763,47	3,00				
BOND FUND -MB- USD							
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND	715	1.931.533,93	0,74				
EB USD							
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND	891	2.337.030,63	0,90				
B USD							

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

Vergütung

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

Gesamtvergütung OGAW

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

Mitarbeitervergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

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

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

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

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

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

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

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

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

Vergütung für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024, die vom OGAW an Vertreter (Tätigkeiten des Portfoliomanagements und des Risikomanagements) gezahlt wurde.	CHF 16.330.069,72 Bestehend aus: - CHF 16.330.069,72 Verwaltungsgebühren - CHF 0,00 Performancegebühren
--	---

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

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

Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")

Arten von SFT

Am 31.03.2024 war der Fonds an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

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

Abwicklung und Clearing

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

Fälligkeitstermin und Sicherheiten

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

Ergänzende Informationen zu Wertpapierleihgeschäften

Zum 31.03.2024 partizipierten die Subfonds ausschließlich am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich (der „Principal“).

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

Subfonds	Währung	Umfang der verliehenen Wertpapiere als Anteil vom gesamten verleihbaren Vermögen (in %)*	Summe des Wertpapierleihgeschäftes im Vergleich zum Nettoinventarwert (%)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	0,91	0,91
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	2,05	2,04
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	2,67	2,65
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	0,21	0,21
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	0,54	0,53
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	0,53	0,52
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	1,40	1,38
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	2,19	2,19
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	4,43	4,37

* 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:

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

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

Subfonds

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	0,41%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	2,69%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	1,14%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	0,03%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	0,21%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	0,12%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	0,76%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	2,53%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	1,62%

Fälligkeitstermin der Sicherheiten in Verbindung mit SFTs

Subfonds	Währung	Fälligkeit der Sicherheit					
		Weniger als 1 Woche	Weniger als 1 Monat	Von 1 Monat bis 3 Monate	Von 3 Monaten bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	27.885,79	65.415,13	75.375,29	660.835,48	1.841.121,75	117.610,33
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	179.608,15	421.328,91	485.480,80	4.256.340,91	11.858.385,43	757.510,29
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	84.546,40	198.330,89	228.528,91	2.003.574,54	5.582.062,07	356.580,54
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	2.139,28	5.018,38	5.782,48	50.696,57	141.243,27	9.022,58
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	14.029,64	32.911,06	37.922,13	332.473,49	926.288,31	59.171,03
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	8.912,96	20.908,23	24.091,74	211.218,74	588.466,30	37.591,06
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	51.874,18	121.687,64	140.215,90	1.229.310,59	3.424.922,74	218.783,09
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	168.675,95	395.683,89	455.931,05	3.997.270,34	11.136.601,45	711.402,93
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	120.259,14	282.106,63	325.060,42	2.849.892,28	7.939.946,97	507.201,55

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 angegeben.

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

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900BYZW6JVJ8J1054

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 34,84% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 21,13%, AA: 33,28%, A: 27,02%, BBB: 10,81%, BB: 3,78%, B: 0,81%, CCC: 0,17%, Nicht bewertbar**: 1,30%, Keine Datenabdeckung**: 1,70%	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	6,64	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,57	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Governance	6,10	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 32,78%, Gelb: 31,42%, Orange: 18,77%, Rot: 0,03%, Nicht bewertbar**: 15,58%, Keine Datenabdeckung**: 1,41%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 18,94%, Neutral: 21,51%, Negativ: 0,84%, Nicht bewertbar**: 0,51%, Keine Datenabdeckung**: 58,21%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,24%, ESG-bewusst: 53,87%, Nachhaltiges Thema: 2,01%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 2,01%, Nicht bewertbar: 36,88%, Keine Datenabdeckung: 4,98%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 19,68%, AA: 30,69%, A: 26,38%, BBB: 11,90%, BB: 3,68%, B: 0,75%, CCC: 0,09%, Nicht bewertbar***: 2,00%, Keine Datenabdeckung**: 4,82%	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	6,56	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,56	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 34,17%, Gelb: 24,40%, Orange: 19,71%, Rot: 0,20%, Nicht bewertbar**: 18,97%, Keine Datenabdeckung**: 2,56%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllt während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 17,42%, Neutral: 21,29%, Negativ: 2,51%, Nicht bewertbar**: 0,33%, Keine Datenabdeckung**: 58,45%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 1,70% ESG-bewusst: 45,90%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,20% Traditionell: 2,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 5,40% Nicht bewertbar: 47,70%,	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	8.240,34	81,41	77,94
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.100,59	81,41	77,94
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	69.435,89	81,41	77,90
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	79.564,87	81,41	77,87
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	288,30	81,41	77,87
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	626,83	81,41	79,51
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	9,18	81,41	79,86
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	39,81	81,41	61,05
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,41	69,63
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	81,41	69,63
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,12	81,41	69,63
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,07	81,41	69,63
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,41	69,63
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,41	69,63
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,41	69,63
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	81,41	69,63
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	81,41	69,63
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,83	81,41	80,00
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,46	81,41	0,56
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,97	81,41	31,46
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
Soziales und Beschäftigung			
10. Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,11	81,41	80,19
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)	23,82	81,41	79,84
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,70	81,41	20,80
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	27,45	81,41	78,66
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	81,41	80,02
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	48,33	15,01	12,87
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	15,01	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,57	15,01	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	2,41	Vereinigte Staaten von Amerika
ASML HOLDING NV	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,04	Niederlande
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,85	Vereinigte Staaten von Amerika
LVMH	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,36	Frankreich
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,99	Taiwan, Volksrepublik China
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,78	Vereinigte Staaten von Amerika
LOREAL SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,77	Frankreich
SCHNEIDER ELECTRIC	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,77	Frankreich
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	0,72	Vereinigte Staaten von Amerika
TOTALENERGIES	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,71	Frankreich
EUROPEAN INVESTMENT BANK / 2,750% / 28.07.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,70	Supranational
KFW / 2,750% / 14.02.2033	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,69	Deutschland
ACEA SPA / 28.09.2025	D. Energieversorgung	0,65	Italien
EON INTERNATIONAL FINANCE BV / 1,250% / 19.10.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,64	Deutschland
ALPHABET INC CLASS C PAR	J. Information und Kommunikation	0,64	Vereinigte Staaten von Amerika

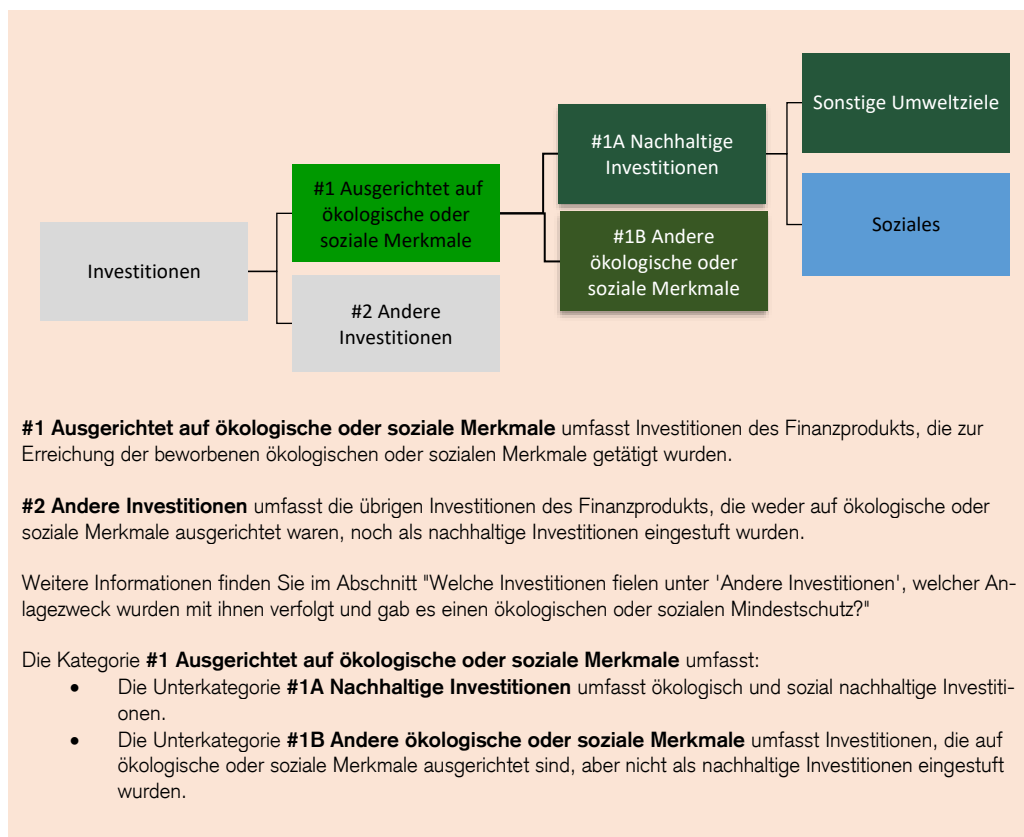
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 92,23% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 34,84 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 57,40 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 7,77 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,04%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,44%
C. Verarbeitendes Gewerbe	28,65%
D. Energieversorgung	3,80%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,18%
F. Baugewerbe	0,61%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,14%
H. Verkehr und Lagerei	1,86%
I. Gastgewerbe	0,44%

J. Information und Kommunikation	12,96%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	26,72%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,31%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,89%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,56%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	13,26%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,36%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,11%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,03%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,23%
Andere	1,35%

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

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

Subfondsengagement 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	0,56%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,05%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,32%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,61%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,22%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,07%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

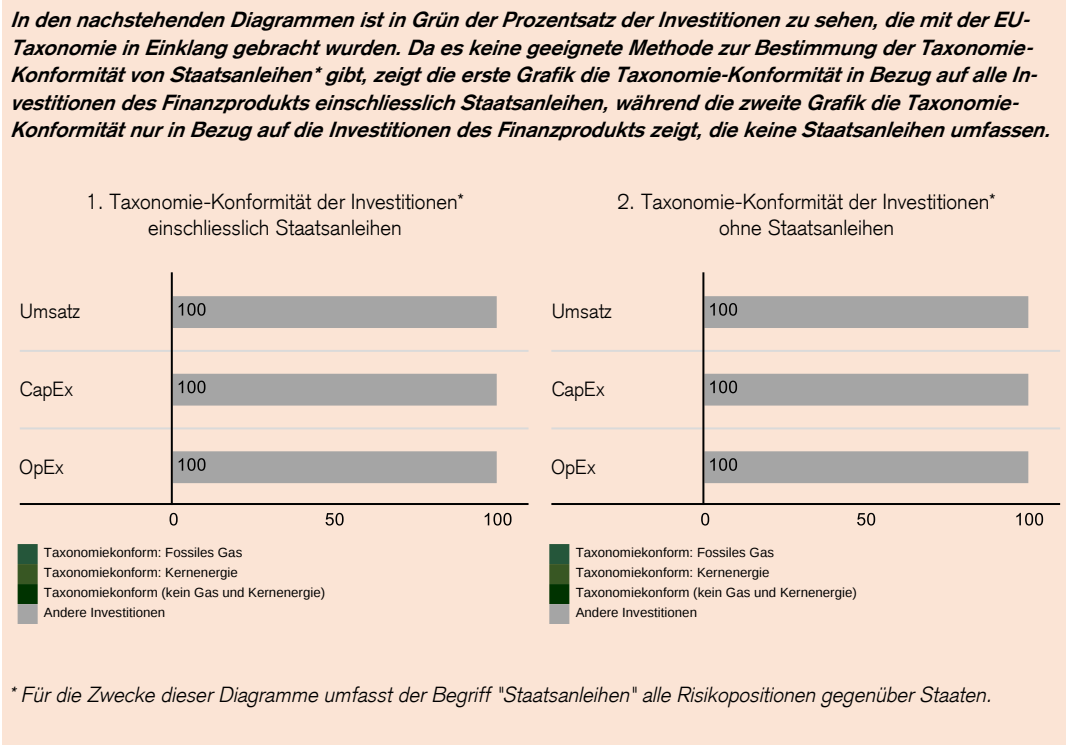
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2024 waren 30,76 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 4,07 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 7,77 % 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 beitrugen. Weitere Informationen über das Engagement des Portfolios in diesen Anlagen sind im Abschnitt Finanzen dieses Jahresberichts aufgeführt. Diese Anlagen hatten keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Sie wurden unter Umständen als Instrumente für die effiziente Portfolioverwaltung, für die Liquiditätssteuerung, für Absicherungszwecke oder als zusätzliche Renditequelle eingesetzt.

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900LSWGYDQPWRPP11

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ ☐ Ja	☒ ☐ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30,59% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 17,07%, AA: 33,50%, A: 31,77%, BBB: 9,25%, BB: 4,70%, B: 0,67%, CCC: 0,17%, Nicht bewertbar**: 0,63%, Keine Datenabdeckung**: 2,22%	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	6,40	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,32	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Governance	6,08	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 37,17%, Gelb: 26,94%, Orange: 18,39%, Rot: 0,03%, Nicht bewertbar**: 14,03%, Keine Datenabdeckung**: 3,44%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 17,96%, Neutral: 22,89% Negativ: 0,72%, Nicht bewertbar**: 0,52%, Keine Datenabdeckung**: 57,91%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,95%, ESG-bewusst: 46,72%, Nachhaltiges Thema: 1,63%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 2,03%, Nicht bewertbar: 43,70%, Keine Datenabdeckung: 4,96%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 13,26%, AA: 34,56%, A: 27,53%, BBB: 11,28%, BB: 4,89%, B: 1,00%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,73%, Keine Datenabdeckung**: 5,64%,	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	6,35	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,25	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	5,91	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 35,45%, Gelb: 21,65%, Orange: 21,55%, Rot: 0,06%, Nicht bewertbar**: 18,42%, Keine Datenabdeckung**: 2,87%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllt während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 15,31%, Neutral: 23,01%, Negativ: 2,72%, Nicht bewertbar**: 0,81%, Keine Datenabdeckung**: 58,15%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 1,50% ESG-bewusst: 31,10% Beeinträchtigung vermeiden: 1,40% Traditionell: 2,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 5,40% Nicht bewertbar: 51,60%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	21.418,90	81,33	73,09
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	5.218,78	81,33	73,09
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	155.306,75	81,33	73,03
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	181.322,73	81,33	73,01
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	210,64	81,33	72,99
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	597,79	81,33	78,57
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	5,02	81,33	79,01
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	38,68	81,33	58,16
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,33	67,80
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	81,33	67,80
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,12	81,33	67,80
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	81,33	67,80
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,33	67,80
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,33	67,80
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	81,33	67,80
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	81,33	67,80
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	81,33	67,80
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,84	81,33	79,16
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,43	81,33	1,78
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,79	81,33	26,61
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)	0,04	81,33	79,28
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)	23,62	81,33	78,99
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,83	81,33	22,41
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	25,66	81,33	77,02
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	81,33	79,19
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	42,31	14,80	10,14
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	14,80	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,27	14,80	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,81	Schweiz
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	2,04	Vereinigte Staaten von Amerika
NOVARTIS AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,98	Schweiz
ROCHE HOLDING PAR AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,70	Schweiz
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,57	Vereinigte Staaten von Amerika
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,02	Taiwan, Volksrepublik China
UBS GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,99	Schweiz
ABB LTD	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,89	Schweiz
COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,85	Schweiz
ZURICH INSURANCE GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,84	Schweiz
QUEBEC (PROVINZ) / 2,040% / 09.05.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,70	Kanada
ABN AMRO BANK NV / 2,625% / 02.03.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,66	Niederlande
BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT UND OESTERREICHISCHE P / 2,955% / 29.11.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,66	Österreich
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,65	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	0,61	Vereinigte Staaten von Amerika

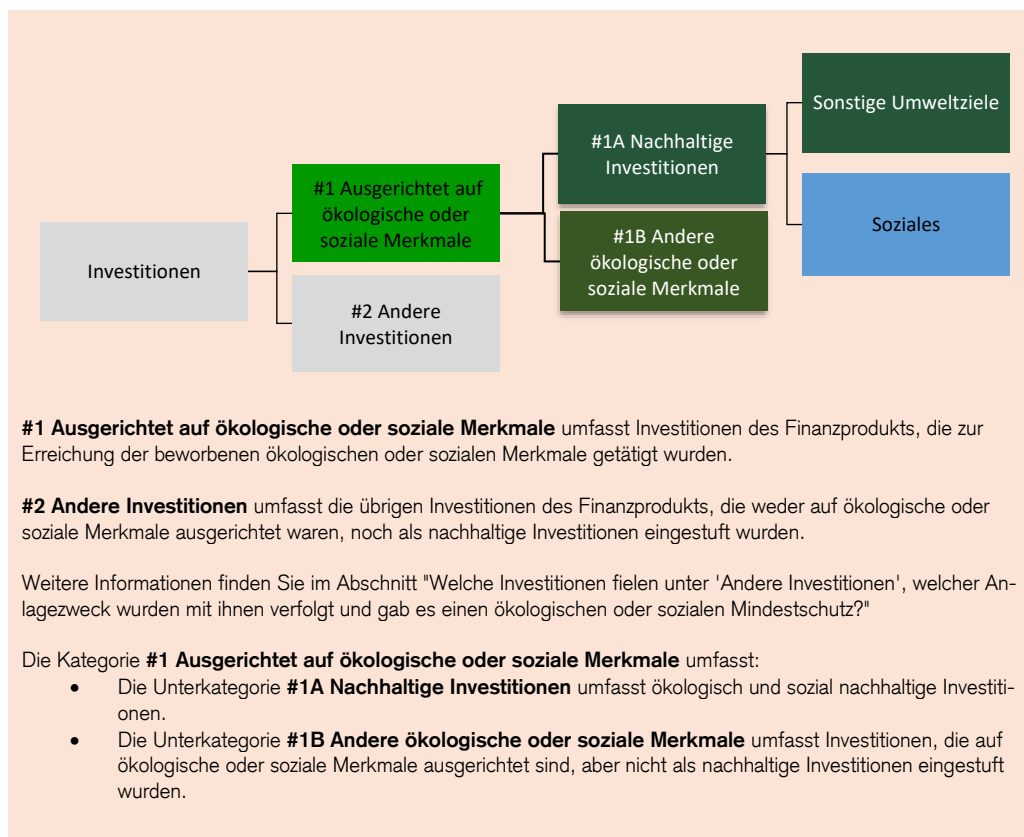
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 93,00% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 30,59 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 62,41 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 7,00 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,32%
C. Verarbeitendes Gewerbe	30,16%
D. Energieversorgung	1,35%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,17%
F. Baugewerbe	0,53%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,74%
H. Verkehr und Lagerei	2,14%
I. Gastgewerbe	0,40%

J. Information und Kommunikation	10,56%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	30,71%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,56%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,04%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,56%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	13,02%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,36%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,11%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,03%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,51%
Andere	0,67%

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

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

Subfondsengagement 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	0,51%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,05%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,27%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,69%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,11%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,07%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

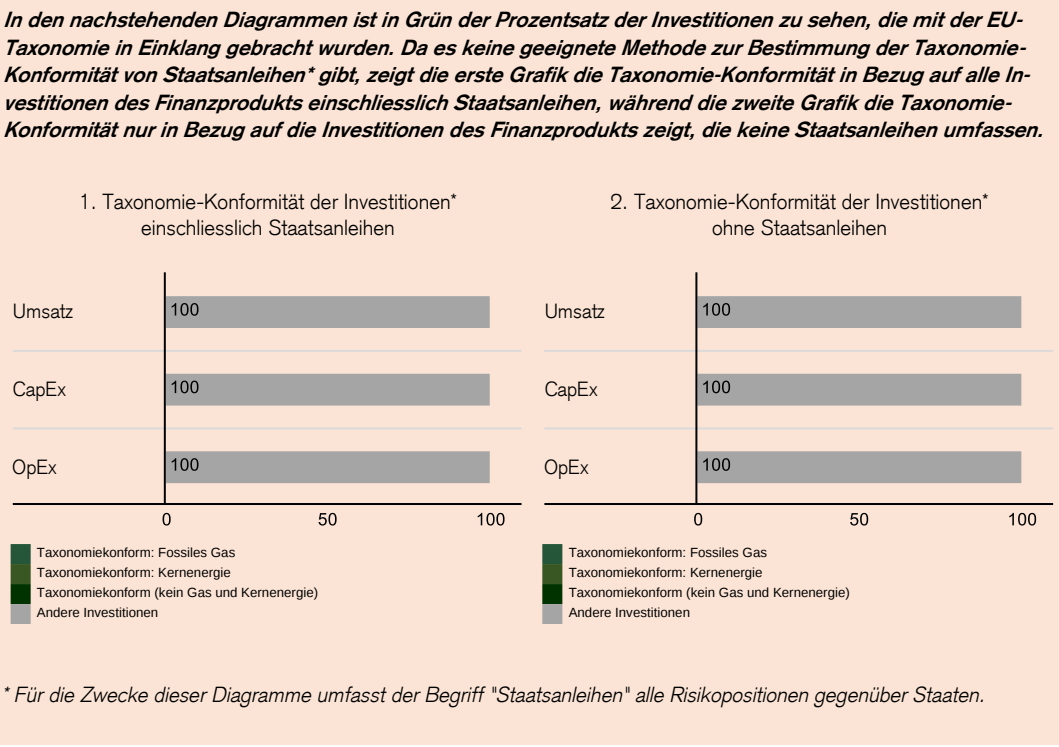
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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



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

Zum 31.03.2024 waren 27,93 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 2,66 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 7,00 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900163C5F373ST027

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,61 % an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

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

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,51 %, AA: 32,23 %, A: 32,38 %, BBB: 12,45 %, BB: 4,17 %, B: 0,64 %, CCC: 0,23 %, Nicht bewertbar**: 1,24 %, Keine Datenabdeckung**: 1,14 %	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	6,44	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,45	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 32,66 %, Gelb: 29,86 %, Orange: 18,36 %, Rot: 0,08 %, Nicht bewertbar**: 17,72 %, Keine Datenabdeckung**: 1,33 %	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100 % Gelb: 0–100 % Orange: 0–100 % Rot: 0–100 %

ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllt während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 16,12%, Neutral: 24,64%, Negativ: 0,74%, Nicht bewertbar**: 0,48%, Keine Datenabdeckung**: 58,02%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,17%, ESG-bewusst: 57,34%, Nachhaltiges Thema: 2,12%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 1,91%, Nicht bewertbar: 33,64%, Keine Datenabdeckung: 4,83%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,14%, AA: 28,46%, A: 32,21%, BBB: 13,39%, BB: 4,16%, B: 0,65%, CCC: 0,09%, Nicht bewertbar***: 1,68%, Keine Datenabdeckung**: 4,22%	Anlagenexposition nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,44	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,43	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	5,74	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 33,89%, Gelb: 22,22%, Orange: 20,72%, Rot: 0,04%, Nicht bewertbar**: 21,35%, Keine Datenabdeckung**: 1,78%	Anlagenexposition nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%

ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 13,21%, Neutral: 25,60%, Negativ: 2,36%, Nicht bewertbar**: 0,34%, Keine Datenabdeckung**: 58,48%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 1,80% ESG-bewusst: 39,10% Beeinträchtigung vermeiden: 0,10% Traditionell: 2,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 5,50% Nicht bewertbar: 51,40%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

— — —

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Ver- mögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
<i>Treibhausgasemissionen</i>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	5.306,84	79,52	76,27
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1.611,00	79,52	76,27
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	51.684,08	79,52	76,24
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	58.267,03	79,52	76,20
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	241,53	79,52	76,18
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	608,49	79,52	78,32
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	6,80	79,52	78,57
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	37,39	79,52	57,46
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,52	66,01
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	79,52	66,01
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,10	79,52	66,01
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,04	79,52	66,01
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,52	66,01
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	79,52	66,01
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	79,52	66,01
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	79,52	66,01
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	79,52	66,01
<i>Biodiversität</i>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,72	79,52	78,71
<i>Wasser</i>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,46	79,52	0,40
<i>Abfall</i>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,75	79,52	26,13
SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG			
<i>Soziales und Beschäftigung</i>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,05	79,52	78,77
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)	29,73	79,52	78,53

12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,21	79,52	16,77
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	25,27	79,52	76,99
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	79,52	78,67
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
<i>Umwelt</i>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	57,47	16,69	15,01
<i>Soziales</i>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	16,69	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,58	16,69	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
<i>Fossile Brennstoffe</i>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<i>Energieeffizienz</i>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	3,88	Vereinigte Staaten von Amerika
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,96	Vereinigte Staaten von Amerika
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,19	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	1,16	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS C PAR	J. Information und Kommunikation	1,03	Vereinigte Staaten von Amerika
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,98	Taiwan, Volksrepublik China
VISA INC CLASS A	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,89	Vereinigte Staaten von Amerika
MASTERCARD INC CLASS A	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,86	Vereinigte Staaten von Amerika
TESLA INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,81	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 1,625% / 15.05.2026	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,78	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,250% / 15.11.2027	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,78	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 4,500% / 15.02.2036	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,69	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,875% / 15.05.2032	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,68	Vereinigte Staaten von Amerika
ING GROEP NV / 4,625% / 06.01.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,66	Niederlande
UNITED STATES TREASURY / 2,000% / 15.02.2025	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,66	Vereinigte Staaten von Amerika

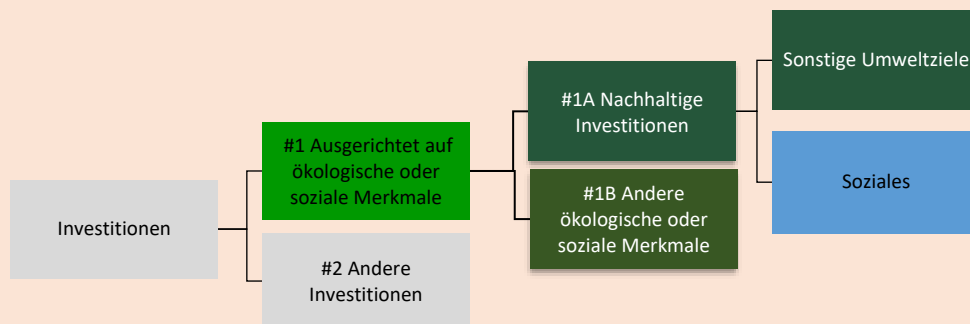
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



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

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

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

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

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

Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 92,52% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 27,61 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 64,91 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 7,48 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,04%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,74%
C. Verarbeitendes Gewerbe	27,30%
D. Energieversorgung	1,82%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,22%
F. Baugewerbe	0,60%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,01%
H. Verkehr und Lagerei	2,09%
I. Gastgewerbe	0,62%
J. Information und Kommunikation	16,17%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	21,88%

L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,61%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,21%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,63%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	14,82%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,62%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,11%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,06%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,11%
Andere	1,29%

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

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

Subfondsengagement 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	0,67%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,05%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,47%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,85%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,12%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,08%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

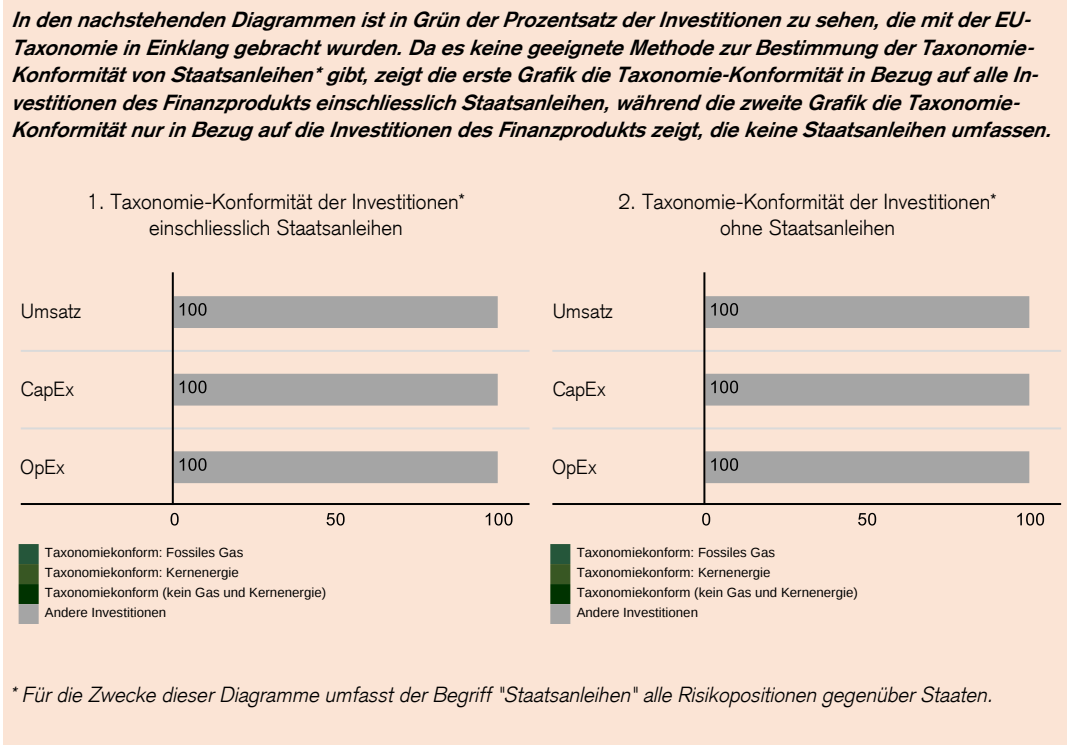
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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



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

Zum 31.03.2024 waren 23,70 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 3,91 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 7,48 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



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

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5299001E9001Q0JD7747

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,85% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 24,64%, AA: 34,92%, A: 24,91%, BBB: 9,06%, BB: 3,23%, B: 0,54%, CCC: 0,08%, Nicht bewertbar**: 1,86%, Keine Datenabdeckung**: 0,75%	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	6,59	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,57	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Governance	6,12	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 38,79%, Gelb: 32,92%, Orange: 16,91%, Rot: 0,01%, Nicht bewertbar**: 10,52%, Keine Datenabdeckung**: 0,85%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 8,67%, Neutral: 10,14%, Negativ: 0,39%, Nicht bewertbar**: 0,23%, Keine Datenabdeckung**: 80,56%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,27%, ESG-bewusst: 60,29%, Nachhaltiges Thema: 2,50%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 0,89%, Nicht bewertbar: 31,44%, Keine Datenabdeckung: 4,60%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 23,07%, AA: 32,07%, A: 25,39%, BBB: 11,10%, BB: 3,03%, B: 0,62%, CCC: 0,06%, Nicht bewertbar**: 1,87%, Keine Datenabdeckung**: 2,78%	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	6,53	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,59	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 40,16%, Gelb: 26,10%, Orange: 19,85%, Rot: 0,10%, Nicht bewertbar**: 12,55%, Keine Datenabdeckung**: 1,24%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 7,38%, Neutral: 10,61%, Negativ: 1,25%, Nicht bewertbar**: 0,24%, Keine Datenabdeckung**: 80,52%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 2,50% ESG-bewusst: 43,10% Beeinträchtigung vermeiden: 0,20% Traditionell: 1,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 5,40% Nicht bewertbar: 47,70%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.762,12	88,12	86,56
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	725,54	88,12	86,56
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	22.740,91	88,12	86,51
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	26.131,23	88,12	86,45
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	303,61	88,12	86,46
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	660,08	88,12	87,13
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	9,36	88,12	87,24
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	44,60	88,12	67,05
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	88,12	76,03
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	88,12	76,03
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,15	88,12	76,03
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,07	88,12	76,03
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	88,12	76,03
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	88,12	76,03
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	88,12	76,03
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	88,12	76,03
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	88,12	76,03
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,99	88,12	87,40
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,35	88,12	0,59
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,28	88,12	35,25
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)	0,05	88,12	87,49
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)	27,23	88,12	87,22
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,24	88,12	20,33
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	30,22	88,12	87,00
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	88,12	87,34
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	29,67	8,87	8,07
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	8,87	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,61	8,87	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	3,31	Vereinigte Staaten von Amerika
ASML HOLDING NV	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,91	Niederlande
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,54	Vereinigte Staaten von Amerika
LVMH	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,94	Frankreich
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,43	Taiwan, Volksrepublik China
LOREAL SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,10	Frankreich
SCHNEIDER ELECTRIC	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,07	Frankreich
TOTALENERGIES	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,01	Frankreich
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	0,99	Vereinigte Staaten von Amerika
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,96	Vereinigte Staaten von Amerika
HERMES INTERNATIONAL	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,91	Frankreich
IBERDROLA SA	D. Energieversorgung	0,89	Spanien
ALPHABET INC CLASS C PAR	J. Information und Kommunikation	0,88	Vereinigte Staaten von Amerika
AXA SA	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,79	Frankreich
VISA INC CLASS A	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,71	Vereinigte Staaten von Amerika

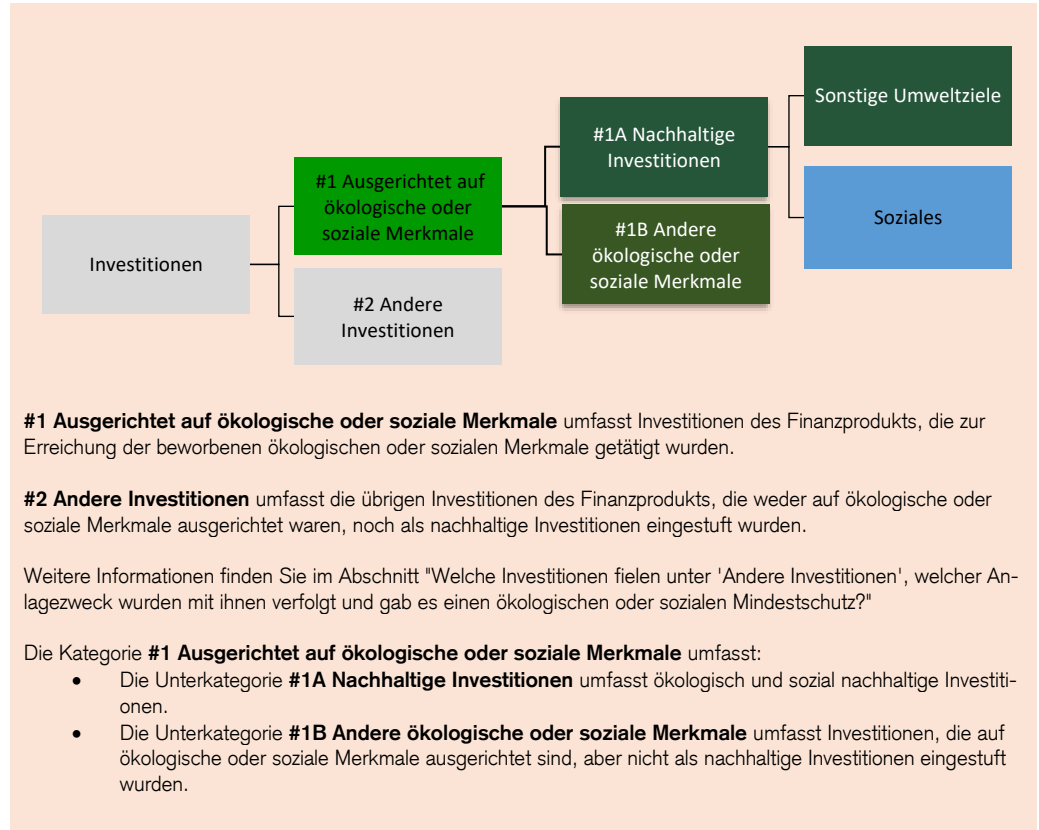
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 93,18 % seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 35,85 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 57,33 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 6,82 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,04%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,46%
C. Verarbeitendes Gewerbe	36,20%
D. Energieversorgung	3,13%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,25%
F. Baugewerbe	0,87%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,15%
H. Verkehr und Lagerei	2,17%
I. Gastgewerbe	0,50%

J. Information und Kommunikation	15,57%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	19,17%,
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,50%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,15%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,70%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	8,36%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,45%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,13%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,06%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,23%
Andere	1,88%

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

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

Subfondsengagement 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	0,48%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,04%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,36%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	2,09%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,18%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,09%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

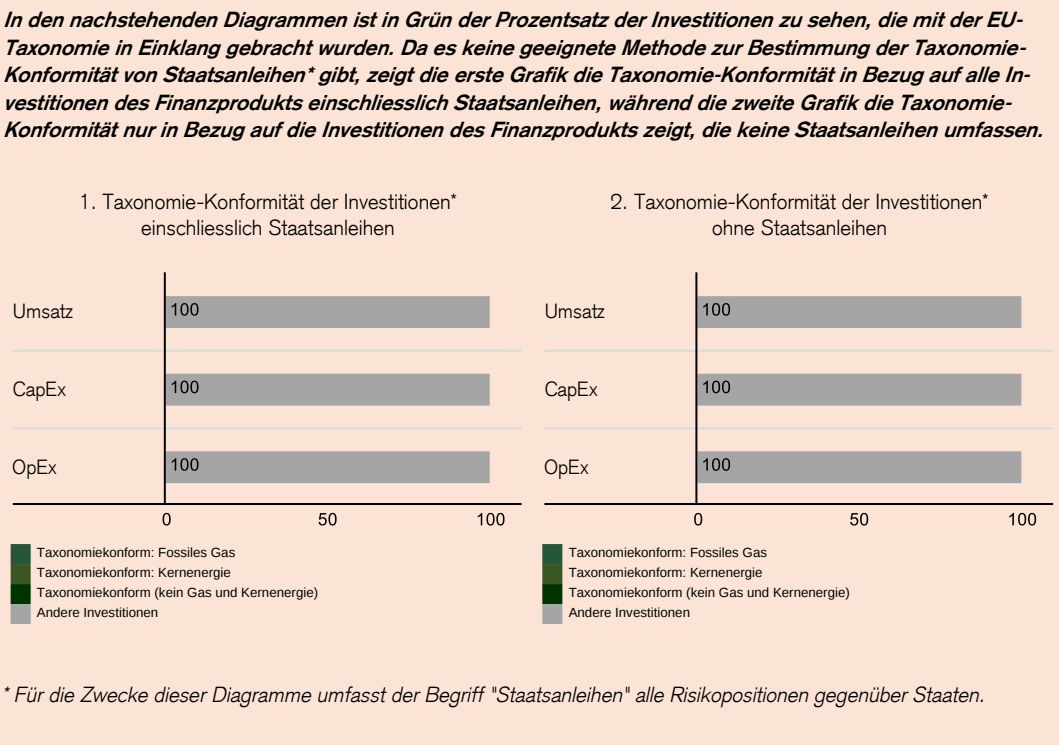
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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



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

Zum 31.03.2024 waren 30,70 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 5,15 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 6,82 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900HON352IXZBV42

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 31,46% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 19,60%, AA: 34,30%, A: 30,25%, BBB: 8,83%, BB: 3,52%, B: 0,50%, CCC: 0,10%, Nicht bewertbar**: 1,60%, Keine Datenabdeckung**: 1,30%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,32	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,38	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Governance	6,06	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 42,08%, Gelb: 28,59%, Orange: 17,83%, Rot: 0,02%, Nicht bewertbar**: 9,28%, Keine Datenabdeckung**: 2,21%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 7,98%, Neutral: 11,02%, Negativ: 0,35%, Nicht bewertbar**: 0,24%, Keine Datenabdeckung**: 80,41%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 3,19%, ESG-bewusst: 49,87%, Nachhaltiges Thema: 2,88%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 0,91%, Nicht bewertbar: 38,41%, Keine Datenabdeckung: 4,74%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,92%, AA: 36,83%, A: 26,96%, BBB: 10,29%, BB: 3,58%, B: 0,98%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,89%, Keine Datenabdeckung**: 3,44%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,36	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,3	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Governance	5,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 40,34%, Gelb: 23,28%, Orange: 22,65%, Rot: 0,03%, Nicht bewertbar**: 11,87%, Keine Datenabdeckung**: 1,83%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 6,40%, Neutral: 11,11%, Negativ: 1,57%, Nicht bewertbar**: 0,25%, Keine Datenabdeckung**: 80,67%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 2,20% ESG-bewusst: 37,40% Beeinträchtigung vermeiden: 3,20% Traditionell: 1,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating**: 5,40 Nicht bewertbar**: 50,70%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	6.566,95	87,38	83,92
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1.616,29	87,38	83,92
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	46.389,38	87,38	83,80
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	54.339,96	87,38	83,77
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	239,61	87,38	83,75
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	621,30	87,38	85,92
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	5,35	87,38	85,97
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	42,91	87,38	63,85
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	87,38	74,09
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	87,38	74,09
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,16	87,38	74,09
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	87,38	74,09
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	87,38	74,09
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	87,38	74,09
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	87,38	74,09
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	87,38	74,09
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	87,38	74,09
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	2,19	87,38	86,15
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,28	87,38	2,30
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,13	87,38	32,24
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)	0,02	87,38	86,28
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)	26,65	87,38	85,95
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,60	87,38	23,58
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	28,04	87,38	85,74
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	87,38	86,17
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	27,40	9,06	6,95
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	9,06	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,36	9,06	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	3,66	Schweiz
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	2,75	Vereinigte Staaten von Amerika
NOVARTIS AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,57	Schweiz
ROCHE HOLDING PAR AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,22	Schweiz
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,12	Vereinigte Staaten von Amerika
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,49	Taiwan, Volksrepublik China
UBS GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,29	Schweiz
ABB LTD	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,13	Schweiz
COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,10	Schweiz
ZURICH INSURANCE GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,09	Schweiz
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,84	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	0,82	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS C PAR	J. Information und Kommunikation	0,73	Vereinigte Staaten von Amerika
LONZA GROUP AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,72	Schweiz
QUEBEC (PROVINZ) / 2,040% / 09.05.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,69	Kanada

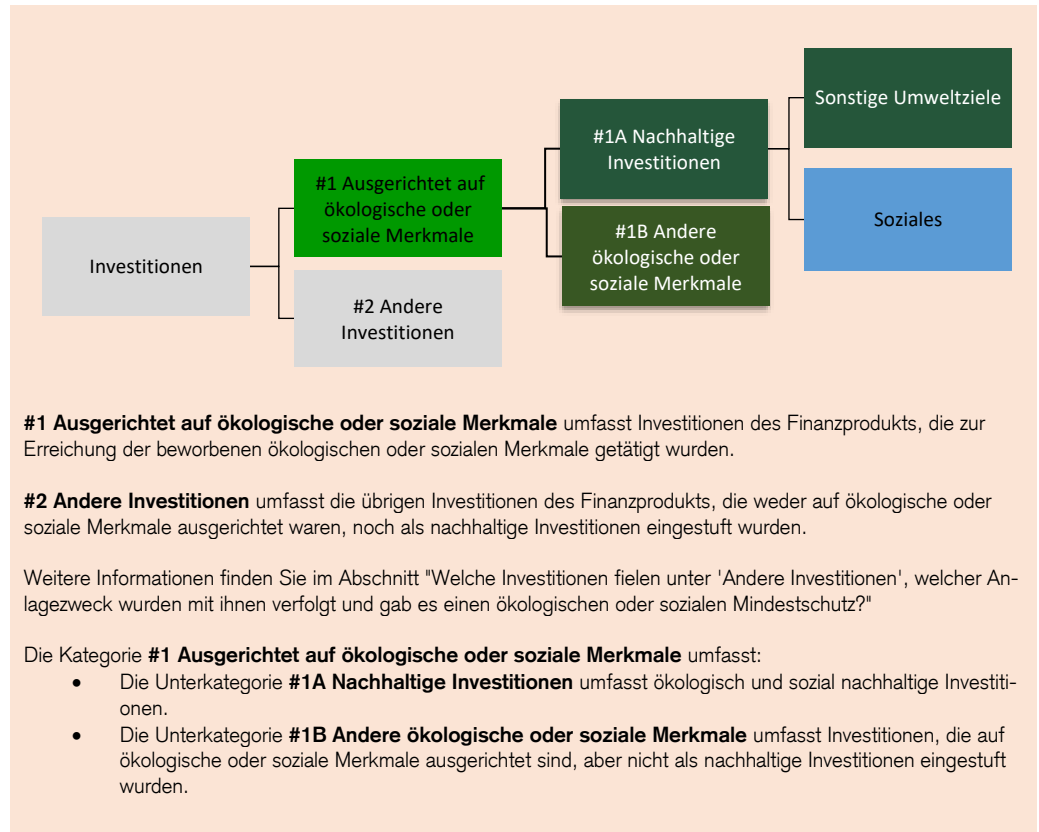
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 93,61 % seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 31,46 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 62,15 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 6,39 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,05%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,35%
C. Verarbeitendes Gewerbe	39,38%
D. Energieversorgung	1,30%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,24%
F. Baugewerbe	0,86%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,56%
H. Verkehr und Lagerei	2,41%
I. Gastgewerbe	0,45%

J. Information und Kommunikation	12,81%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	21,16%,
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,63%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,31%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,63%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	8,43%,
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,42%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,11%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,04%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,22%
Andere	1,61%

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

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

Subfondsengagement 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	0,42%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,04%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,33%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,85%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,12%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,08%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

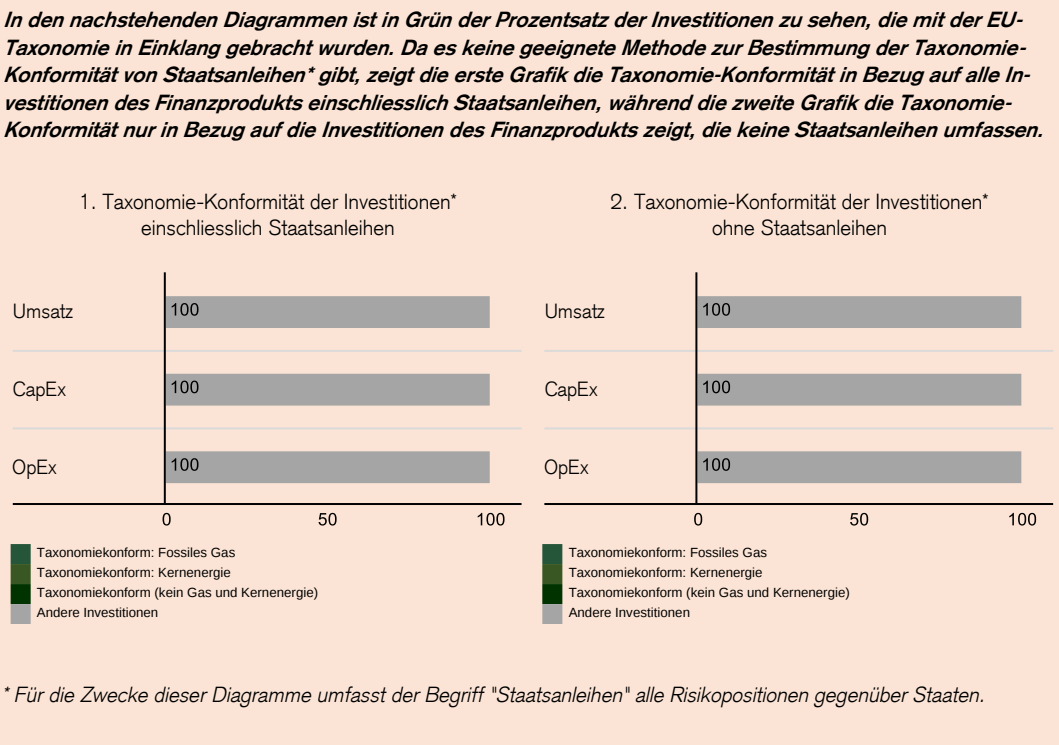
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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



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

Zum 31.03.2024 waren 27,97 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 3,49 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 6,39 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900HSSABB13G0TV87

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 29,09% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 18,68%, AA: 33,95%, A: 31,03%, BBB: 10,34%, BB: 3,31%, B: 0,45%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,51%, Keine Datenabdeckung**: 0,63%	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	6,47	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,45	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Unternehmensführung	5,90	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 37,34%, Gelb: 33,77%, Orange: 15,87%, Rot: 0,03%, Nicht bewertbar**: 12,22%, Keine Datenabdeckung**: 0,77%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 7,16%, Neutral: 11,95%, Negativ: 0,35%, Nicht bewertbar**: 0,24%, Keine Datenabdeckung**: 80,30%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,19%, ESG-bewusst: 53,18%, Nachhaltiges Thema: 1,88%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 0,93%, Nicht bewertbar: 39,30%, Keine Datenabdeckung: 4,51%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 18,97%, AA: 31,73%, A: 29,19%, BBB: 12,12%, BB: 3,02%, B: 0,50%, CCC: 0,06%, Nicht bewertbar**: 1,93%, Keine Datenabdeckung**: 2,50%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	6,55	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,46	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	5,76	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 37,70%, Gelb: 26,11%, Orange: 19,99%, Rot: 0,03%, Nicht bewertbar**: 15,11%, Keine Datenabdeckung**: 1,06%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 6,02%, Neutral: 11,93%, Negativ: 1,15%, Nicht bewertbar**: 0,24%, Keine Datenabdeckung**: 80,66%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 1,70% ESG-bewusst: 33,00% Beeinträchtigung vermeiden: 0,20% Traditionell: 1,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 0,00% Nicht bewertbar: 58,80%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.708,02	86,70	84,82
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	886,34	86,70	84,82
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	28.274,44	86,70	84,76
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	31.689,60	86,70	84,71
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	251,49	86,70	84,72
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	653,12	86,70	85,86
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	7,09	86,70	86,00
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	41,58	86,70	63,59
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,70	73,42
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	86,70	73,42
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,12	86,70	73,42
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,04	86,70	73,42
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,70	73,42
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	86,70	73,42
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	86,70	73,42
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	86,70	73,42
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	86,70	73,42
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,77	86,70	86,14
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,31	86,70	0,43
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	1,16	86,70	30,43
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)	0,02	86,70	86,20
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)	31,96	86,70	85,98
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	1,89	86,70	18,61
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	28,11	86,70	85,23
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	86,70	86,10
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	34,98	10,67	9,59
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	10,67	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,68	10,67	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	5,92	Vereinigte Staaten von Amerika
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	4,48	Vereinigte Staaten von Amerika
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,94	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	1,77	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS C PAR	J. Information und Kommunikation	1,57	Vereinigte Staaten von Amerika
VISA INC CLASS A	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,45	Vereinigte Staaten von Amerika
MASTERCARD INC CLASS A	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,43	Vereinigte Staaten von Amerika
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,43	Taiwan, Volksrepublik China
TESLA INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,29	Vereinigte Staaten von Amerika
CATERPILLAR INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,13	Vereinigte Staaten von Amerika
PROCTER & GAMBLE	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,05	Vereinigte Staaten von Amerika
HOME DEPOT INC	G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,04	Vereinigte Staaten von Amerika
JOHNSON & JOHNSON	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,99	Vereinigte Staaten von Amerika
UNION PACIFIC CORP	H. Verkehr und Lagerei	0,91	Vereinigte Staaten von Amerika
ASML HOLDING NV	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,90	Niederlande

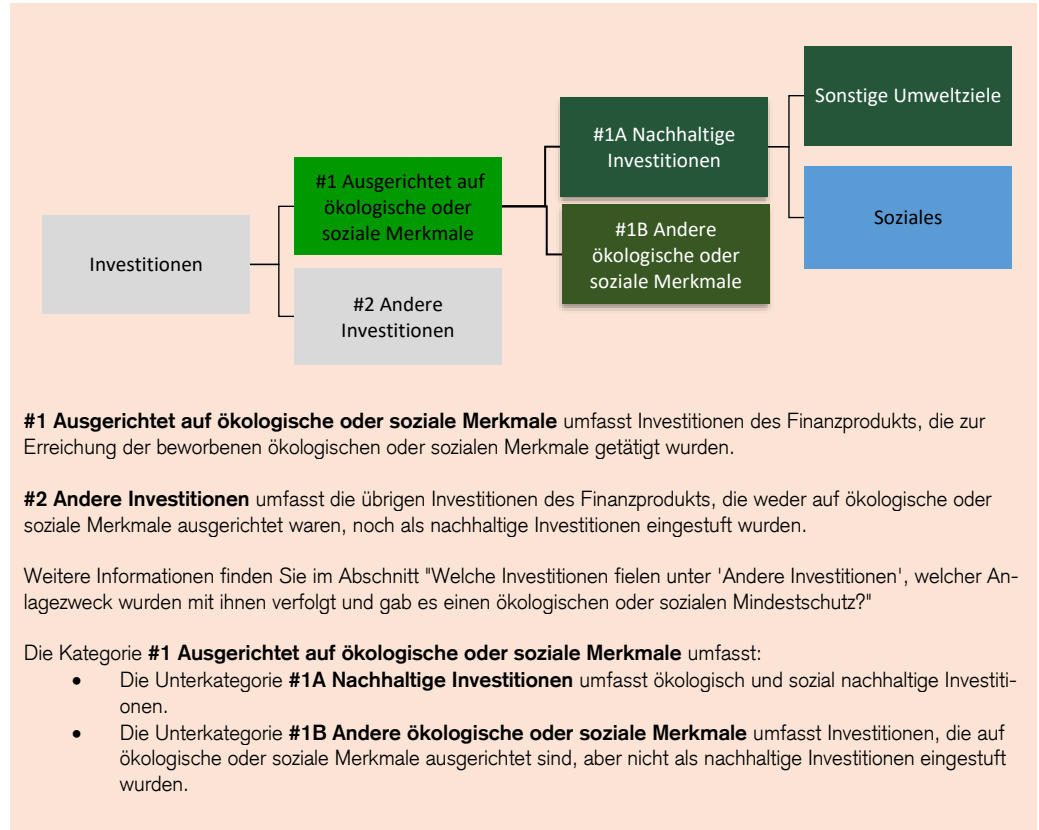
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 93,53% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 29,09 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 64,45 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 6,47 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,84%
C. Verarbeitendes Gewerbe	33,13%
D. Energieversorgung	1,73%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,24%
F. Baugewerbe	0,68%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,27%
H. Verkehr und Lagerei	2,40%
I. Gastgewerbe	0,76%

J. Information und Kommunikation	19,82%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	16,91%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,84%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,17%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,69%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	9,64%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,51%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,12%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,06%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,59%
Andere	1,52%

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

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

Subfondsengagement 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	0,46%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,04%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,76%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,04%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,14%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Grosshandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,09%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

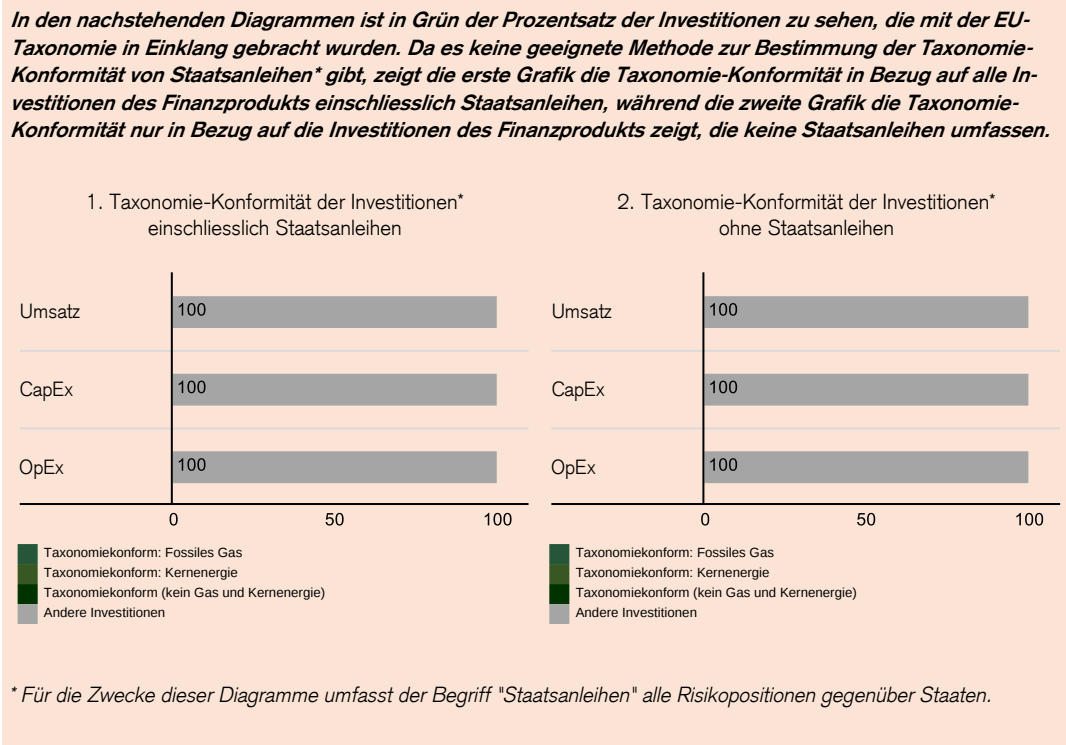
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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



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

Zum 31.03.2024 waren 23,60 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 5,49 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 6,47 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900RAL1DIYKWCES60

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 33,83% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 17,24%, AA: 30,37%, A: 27,74%, BBB: 14,75%, BB: 4,39%, B: 1,00%, CCC: 0,23%, Nicht bewertbar**: 1,72%, Keine Datenabdeckung**: 2,57%	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	6,59	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,66	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Governance	6,21	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 26,51 %, Gelb: 27,64 %, Orange: 17,72 %, Rot: 0,04 %, Nicht bewertbar**: 26,20 %, Keine Datenabdeckung**: 1,89 %	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100 % Gelb: 0–100 % Orange: 0–100 % Rot: 0–100 %
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 25,93 %, Neutral: 33,53 %, Negativ: 1,19 %, Nicht bewertbar**: 0,78 %, Keine Datenabdeckung**: 38,57 %	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100 % Neutral: 0–100 % Negativ: 0–100 %
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00 %, Beeinträchtigung vermeiden: 0,16 %, ESG-bewusst: 47,20 %, Nachhaltiges Thema: 1,37 %, Wirkung: 0,00 %, Nicht nachhaltig: 3,10 %, Nicht bewertbar: 43,16 %, Keine Datenabdeckung: 5,01 %	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,15 %, AA: 27,49 %, A: 28,29 %, BBB: 16,24 %, BB: 4,30 %, B: 0,81 %, CCC: 0,11 %, Nicht bewertbar**: 1,67 %, Keine Datenabdeckung**: 5,94 %	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	6,30	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,63	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	6,02	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 28,30%, Gelb: 21,39%, Orange: 15,89%, Rot: 0,15%, Nicht bewertbar**: 31,57%, Keine Datenabdeckung**: 2,70%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllt während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 23,24%, Neutral: 34,59%, Negativ: 3,61%, Nicht bewertbar**: 0,43%, Keine Datenabdeckung**: 38,13%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 1,20% ESG-bewusst: 37,70% Beeinträchtigung vermeiden: 0,10% Traditionell: 3,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 5,60% Nicht bewertbar: 52,40%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	8.702,69	67,87	62,92
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2.192,75	67,87	62,92
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	69.390,12	67,87	62,89
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	80.045,49	67,87	62,87
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	239,07	67,87	62,84
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	527,98	67,87	65,59
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	8,33	67,87	65,91
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	32,12	67,87	50,66
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	67,87	57,58
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	67,87	57,58
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,08	67,87	57,58
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,06	67,87	57,58
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	67,87	57,58
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	67,87	57,58
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	67,87	57,58
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	67,87	57,58
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	67,87	57,58
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,49	67,87	66,03
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,51	67,87	0,40
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	2,22	67,87	25,14
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)	0,10	67,87	66,29
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)	18,67	67,87	65,89
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,80	67,87	19,48
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	22,41	67,87	64,47
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	67,87	66,17
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	85,29	27,57	23,29
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	27,57	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,54	27,57	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	1,40	Vereinigte Staaten von Amerika
ASML HOLDING NV	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,22	Niederlande
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,08	Vereinigte Staaten von Amerika
IBERDROLA FINANZAS SAU / 3,375% / 22.11.2032	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,86	Spanien
KFW / 2,750% / 14.02.2033	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,85	Deutschland
E.ON SE / 0,875% / 20.08.2031	D. Energieversorgung	0,83	Deutschland
PORTUGAL (REPUBLIK) / 1,950% / 15.06.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,83	Portugal
LVMH	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,82	Frankreich
ING GROEP NV / 2,500% / 15.11.2030	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,81	Niederlande
SPANIEN (KÖNIGREICH) / 1,400% / 30.07.2028	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,81	Spanien
BANCO SANTANDER SA / 0,300% / 04.10.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,79	Spanien
KFW / 0,010% / 05.05.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,78	Deutschland
INTESA SANPAOLO SPA / 0,750% / 16.03.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,76	Italien
SPANIEN (KÖNIGREICH) / 0,600% / 31.10.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,75	Spanien
PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA / 0,875% / 09.07.2029	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,74	Luxemburg

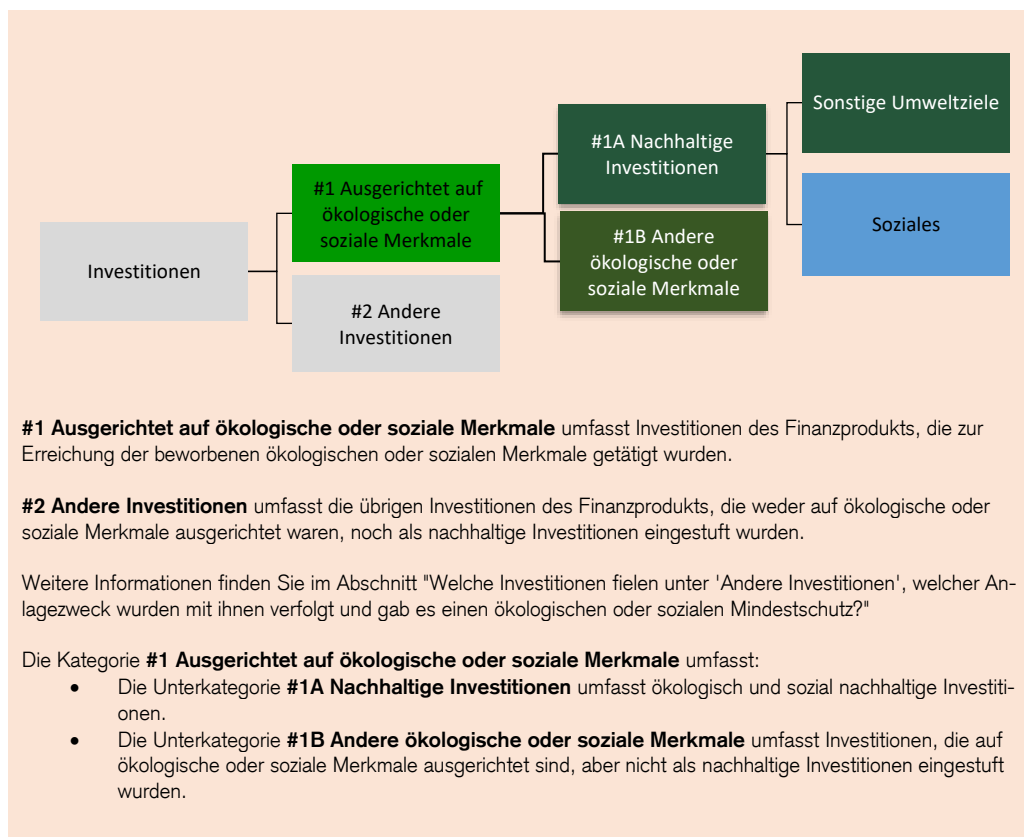
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 90,66% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 33,83 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 56,83 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 9,34 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,34%
C. Verarbeitendes Gewerbe	20,31%
D. Energieversorgung	3,44%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,13%
F. Baugewerbe	0,45%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,44%
H. Verkehr und Lagerei	1,46%
I. Gastgewerbe	0,34%

J. Information und Kommunikation	9,33%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	30,56%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,05%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,73%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,53%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	23,03%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,35%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,11%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,03%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,51%
Andere	1,81%

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

Subfondsengagement 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	0,06%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,19%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,14%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,19%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,07%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

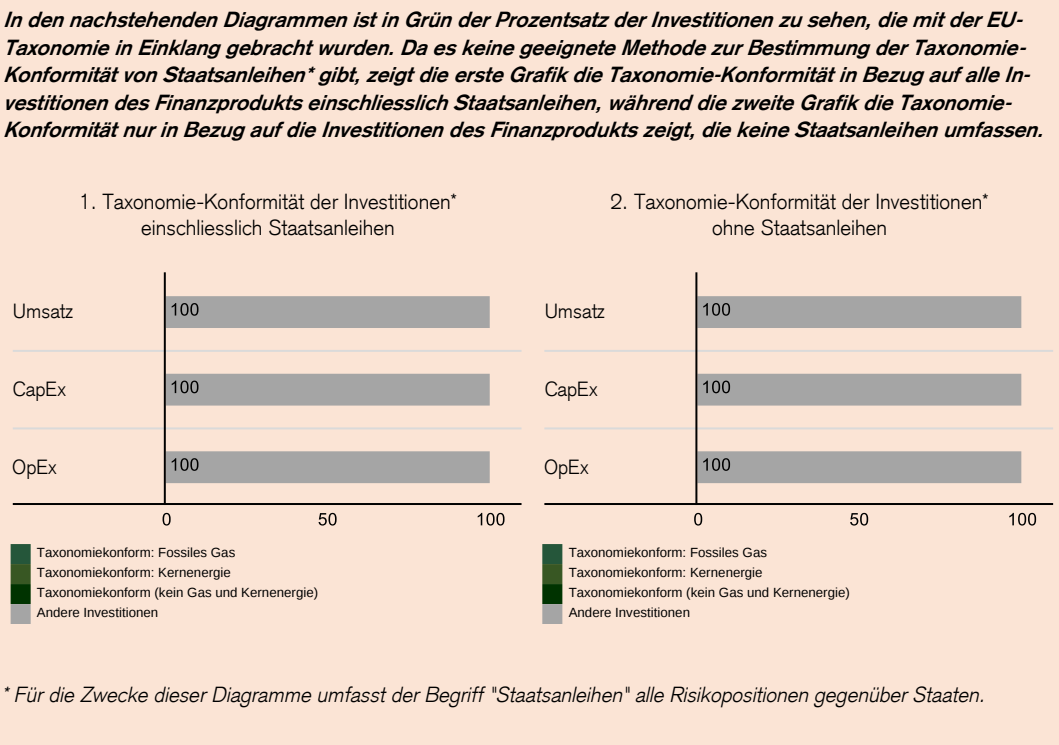
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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



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

Zum 31.03.2024 waren 31,13 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 2,70 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 9,34 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5299004MFUN5FVOXWP48

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,93% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 13,48%, AA: 32,46%, A: 32,90%, BBB: 10,79%, BB: 5,59%, B: 0,89%, CCC: 0,26%, Nicht bewertbar**: 0,14%, Keine Datenabdeckung**: 3,49%	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	6,46	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,25	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Governance	6,06	Portfolio-Gesamtscore der Säule Governance: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 33,79%, Gelb: 24,56%, Orange: 18,86%, Rot: 0,05%, Nicht bewertbar**: 18,14%, Keine Datenabdeckung**: 4,59%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 26,04%, Neutral: 34,62%, Negativ: 1,12%, Nicht bewertbar**: 0,81%, Keine Datenabdeckung**: 37,41%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,94%, ESG-bewusst: 44,06%, Nachhaltiges Thema: 1,32%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 3,18%, Nicht bewertbar: 45,30%, Keine Datenabdeckung: 5,20%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 12,11%, AA: 31,35%, A: 28,59%, BBB: 11,54%, BB: 5,84%, B: 1,14%, CCC: 0,13%, Nicht bewertbar**: 1,74%, Keine Datenabdeckung**: 7,58%	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	6,36	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,24	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	5,90	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 34,51%, Gelb: 18,55%, Orange: 19,05%, Rot: 0,07%, Nicht bewertbar**: 24,18%, Keine Datenabdeckung**: 3,64%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllt während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 24,16%, Neutral: 32,80%, Negativ: 3,97%, Nicht bewertbar**: 1,05%, Keine Datenabdeckung**: 38,02%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 1,10% ESG-bewusst: 37,10% Beeinträchtigung vermeiden: 1,40% Traditionell: 3,10% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 5,50% Nicht bewertbar: 51,90%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	14.553,27	75,93	62,98
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	3.356,57	75,93	62,98
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	111.033,48	75,93	62,92
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	128.441,17	75,93	62,91
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	181,79	75,93	62,87
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	578,59	75,93	72,08
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	5,11	75,93	72,64
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	35,35	75,93	53,33
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	75,93	62,15
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	75,93	62,15
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,09	75,93	62,15
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,03	75,93	62,15
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	75,93	62,15
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	75,93	62,15
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	75,93	62,15
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	75,93	62,15
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	75,93	62,15
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,34	75,93	72,79
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,52	75,93	1,13
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	2,25	75,93	19,98
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)	0,05	75,93	72,96
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)	22,00	75,93	72,61
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,89	75,93	19,78
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	23,64	75,93	69,97
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	75,93	72,89
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	61,16	19,46	13,34
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	19,46	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,22	19,46	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,67	Schweiz
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	1,24	Vereinigte Staaten von Amerika
NOVARTIS AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,17	Schweiz
QUEBEC (PROVINZ) / 2,040% / 09.05.2033	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,10	Kanada
ROCHE HOLDING PAR AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,01	Schweiz
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,96	Vereinigte Staaten von Amerika
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK / 0,200% / 28.11.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,81	Supranational
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD / 0,125% / 21.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,77	Australien
ABN AMRO BANK NV / 2,625% / 02.03.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,76	Niederlande
BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT UND OESTERREICHISCHE P / 2,955% / 29.11.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,76	Österreich
MUENCHENER HYPOTHEKENBK EG / 0,250% / 18.09.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,71	Deutschland
COOPERATIEVE RABOBANK UA / 0,250% / 25.11.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,65	Niederlande
BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA / 0,110% / 15.12.2028	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,64	Lateinamerika, supranational
FIRST ABU DHABI BANK PJSC / 0,068% / 31.03.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,61	Vereinigte Arabische Emirate
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,60	Taiwan, Volksrepublik China

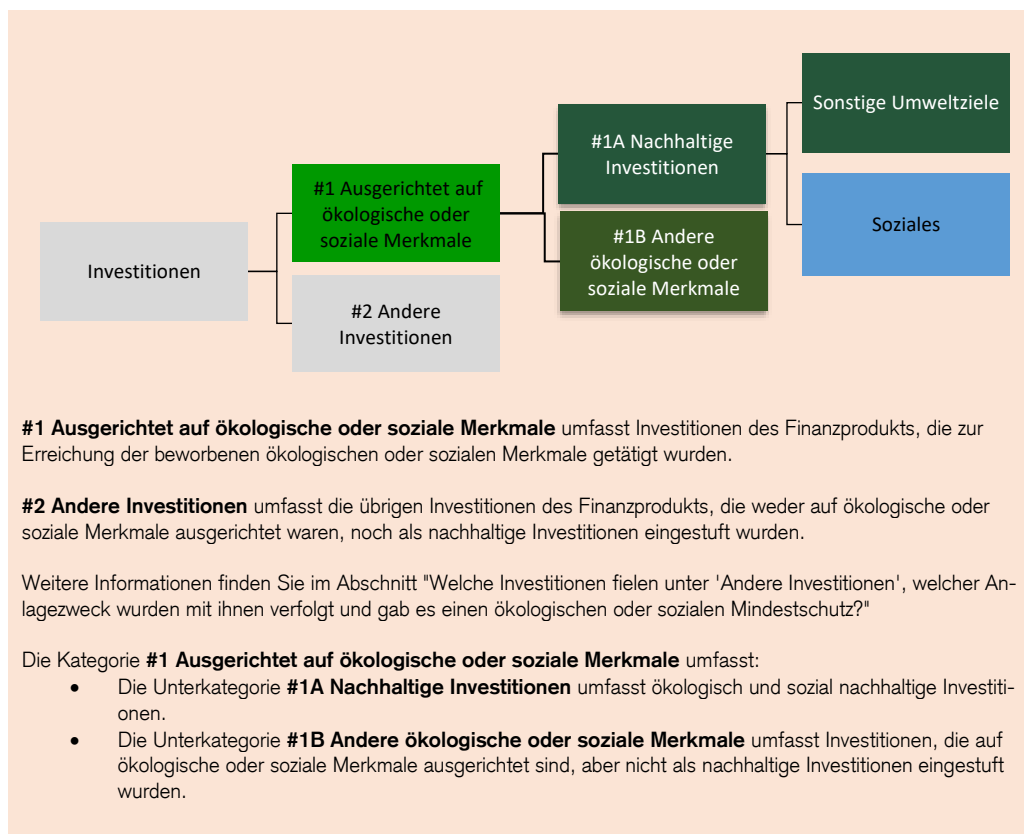
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 92,09% seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 27,93 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 64,17 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 7,91 % seines Gesamtnettvermögens.

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,34%
C. Verarbeitendes Gewerbe	21,10%
D. Energieversorgung	1,56%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,12%
F. Baugewerbe	0,40%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,30%
H. Verkehr und Lagerei	1,90%
I. Gastgewerbe	0,35%

J. Information und Kommunikation	7,95%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	39,35%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,35%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,83%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,50%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	17,37%
P. Bildung	0,02%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,36%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,10%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,03%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,83%
Andere	0,23%

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

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

Subfondsengagement 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	0,06%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,19%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,58%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,10%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,07%

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

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

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

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

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



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

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

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

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

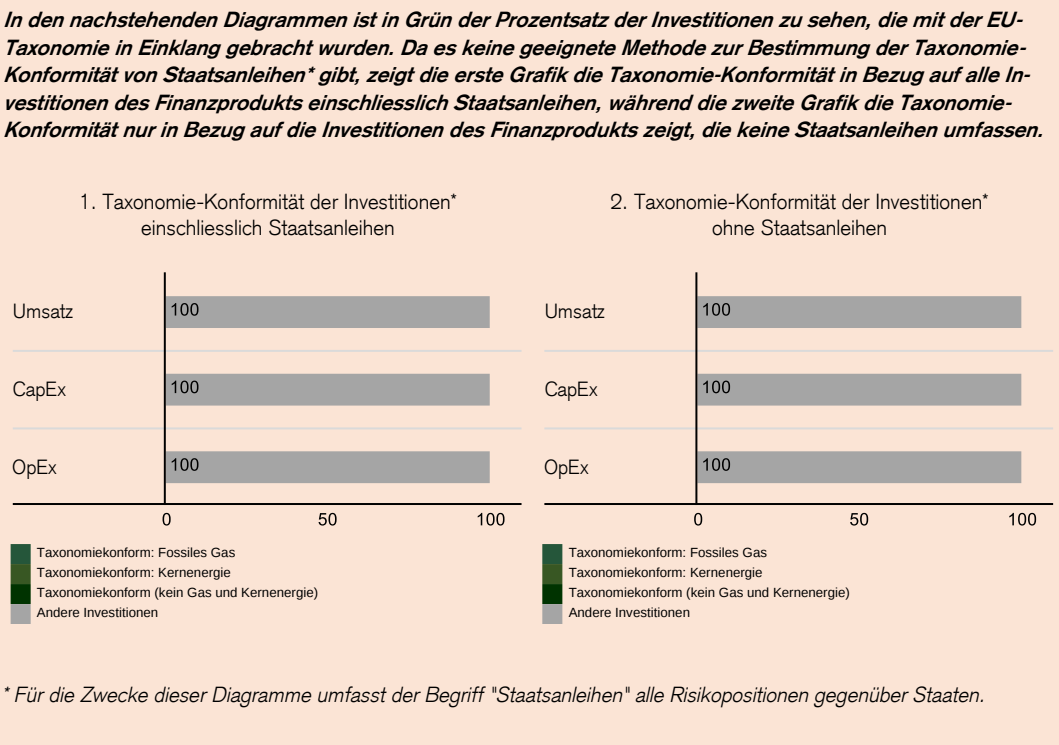
☒

Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

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

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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



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

Zum 31.03.2024 waren 26,10 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 1,82 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2024 waren 7,91 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

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

- Mitwirkung

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

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

Name des Produkts: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900ZNI5E2QV31N773

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,94 % an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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



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

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

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

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

Dieser Subfonds bewirbt folgende ökologische und soziale Merkmale:

- Investieren in Unternehmen, die sich an die internationalen Verträge über umstrittene Waffen halten (normenbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- höheres Engagement in Investitionen mit einem besseren ESG-Profil und weniger ESG-Kontroversen über ihren Anlagezyklus (ESG-Integration)
- Bei festverzinslichen Anlagen ein höheres Engagement in Investitionen mit einem positiven oder neutralen ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen und Begrenzen des Engagements in Investitionen mit negativem Warnsignal (ESG-Integration)
- Bei Fondsinvestitionen eine Mehrheit von Zielfonds, die einen "ESG Integration", "Sustainable Thematic" oder "Impact Investing" Ansatz gemäß dem unternehmenseigenen Klassifizierungssystem, das im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschrieben ist, aufweisen (ESG-Integration)
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit den Richtlinien für nachhaltiges Investieren von CSAM (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 14,07%, AA: 29,15%, A: 34,01%, BBB: 13,33%, BB: 4,83%, B: 0,88%, CCC: 0,31%, Nicht bewertbar**: 1,68%, Keine Datenabdeckung**: 1,74%	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	6,39	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,54	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Score der Säule Governance	5,95	Aggregierter Portfolio-Score der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 25,36%, Gelb: 26,22%, Orange: 19,29%, Rot: 0,09%, Nicht bewertbar**: 27,24%, Keine Datenabdeckung**: 1,79%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllte während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 23,85%, Neutral: 35,72%, Negativ: 1,15%, Nicht bewertbar**: 0,76%, Keine Datenabdeckung**: 38,51%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Traditionell: 0,00%, Beeinträchtigung vermeiden: 0,14%, ESG-bewusst: 51,65%, Nachhaltiges Thema: 1,36%, Wirkung: 0,00%, Nicht nachhaltig: 3,00%, Nicht bewertbar: 38,71%, Keine Datenabdeckung: 5,13%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 12,66%, AA: 25,26%, A: 36,71%, BBB: 13,10%, BB: 4,85%, B: 0,77%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,10%, Keine Datenabdeckung**: 5,45%	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	6,39	Portfolio-Gesamtscore der Säule Umwelt: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Soziales	5,48	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	5,70	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)

Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 26,48%, Gelb: 19,50%, Orange: 20,29%, Rot: 0,07%, Nicht bewertbar**: 31,55%, Keine Datenabdeckung**: 2,11%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM***	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstossen. Erkannte Verstösse werden gemeldet und behoben.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden (CSAM erfüllt während des gesamten Bezugszeitraums die ESG-Ausschlusskriterien, wie in der Richtlinie für nachhaltiges Investieren von CSAM dargelegt).
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 19,39%, Neutral: 39,06%, Negativ: 3,53%, Nicht bewertbar**: 0,43%, Keine Datenabdeckung**: 37,59%	Portfolioexposure nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen: Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%
ESG-Klassifizierung der Zielfonds	Wirkung: 0,00% Nachhaltiges Thema: 1,40% ESG-bewusst: 39,50% Beeinträchtigung vermeiden: 0,10% Traditionell: 3,00% Nicht nachhaltig: 0,00% Kein Rating: 5,50% Nicht bewertbar: 50,60%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Traditionell: 0 % – 100 % Beeinträchtigung vermeiden: 0 % – 100 % ESG-bewusst: 0 % – 100 % Nachhaltiges Thema: 0 % – 100 % Wirkung: 0 % – 100 % Nicht nachhaltig: 0 % – 100 %

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

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

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

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

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

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

Die vorstehenden Kriterien wurden anhand einer quantitativen Methode beurteilt. Soweit kein Ergebnis aus der quantitativen Beurteilung vorlag (z. B. bei fehlenden quantitativen ESG-Daten), wurden die Investitionen zur Bestätigung fallweise einer eigenen Beurteilung der Kriterien unterzogen. Diese Fälle wurden durch einen zentralen Ausschuss von Credit Suisse genehmigt.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt?***

CSAM betrachtete verschiedene Indikatoren im Zusammenhang mit den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) und weitere Indikatoren aus ihrem Rahmenwerk für Ausschlüsse, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale Anlageziele erheblich beeinträchtigten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— — — ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Während des Bezugszeitraums umfassten die von CSAM angewendeten PAI-Indikatoren zur Ermittlung von Anlagen, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR im Einklang mit der CS SFDR Sustainable Investment Methodology einzustufen sind, folgende Kriterien und Schwellenwerte zur Bestimmung dessen, ob eine Investition der DNSH-Bedingung genügt:

Investitionen dürfen:

1. keinen erheblichen negativen Beitrag zum Klimawandel leisten. Bei diesem Kriterium kommt ein Indikator zum Einsatz, der die grössten Emittenten von Treibhausgasen weltweit anzeigt und sich auf die PAI 1, 2, 3 und 15 bezieht.
2. keinen normen-, werte- und verhaltensbasierten Ausschlüssen und anderen Anlagebeschränkungen unterliegen, die sich auf die PAI 4, 10, 14 und 16 beziehen.
3. keinen schweren ESG-Kontroversen unterliegen, die sich gegebenenfalls auf die PAI 7 und 10 beziehen.
4. bei der ESG-Performance im Branchenvergleich nicht deutlich zurückliegen. Dieses Kriterium wurde angewendet, um die übrigen PAI so weit wie möglich abzudecken.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Die Ausrichtung wurde als Teil des CS-Rahmenwerks für ESG-Ausschlüsse beurteilt. Unternehmen, die erhebliche Schwächen in ihrem Geschäftsverhalten aufweisen, insbesondere bezüglich der Verletzung der Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC), und Unternehmen, die auf der Beobachtungsliste stehen, aber noch nicht direkt ausgeschlossen wurden, werden als Unternehmen gekennzeichnet, die aufgrund der Verletzung des DNSH-Grundsatzes nicht als nachhaltige Investitionen im Sinne der SFDR gelten.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle zeigt das Exposure gegenüber allen obligatorischen PAI aus der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission. Die Nachhaltigkeitsindikatoren/Messgrößen für nachteilige Auswirkungen werden als nach Vermögenswerten gewichteter Durchschnitt der Quartalsdaten berechnet, die dem Bezugszeitraum vom 01.04.2023 bis zum 31.03.2024 entsprechen.

Bitte beachten Sie, dass CSAM beschliessen kann oder unter Umständen nicht in der Lage ist, aufgrund der Anlagestrategie, der Anlageklasse oder der Verfügbarkeit von zuverlässigen Daten alle hier genannten PAI zu berücksichtigen und/oder abzuschwächen. Die Berücksichtigung von PAI kann angesichts der zunehmenden Verfügbarkeit und Qualität von Daten Änderungen unterliegen. Eine aktuelle Übersicht über die PAI, die auf Subfondsebene berücksichtigt werden, finden Sie im EET.

Weitere Informationen über das PAI-Rahmenwerk von CSAM erhalten Sie online auf www.credit-suisse.com/esg.

Nachhaltigkeitsindikator/Messgrösse für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird			
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN			
Treibhausgasemissionen			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	5.056,84	70,55	64,92
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1.415,96	70,55	64,92
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	45.735,39	70,55	64,89
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	52.003,68	70,55	64,87
2. CO ₂ -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	215,32	70,55	64,83
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	582,21	70,55	68,79
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent) ****	6,32	70,55	69,38
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	32,10	70,55	50,46
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	70,55	57,70
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	70,55	57,70
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,08	70,55	57,70
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,04	70,55	57,70
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	70,55	57,70
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	70,55	57,70
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,00	70,55	57,70
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,02	70,55	57,70
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) *****	0,01	70,55	57,70
Biodiversität			

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	1,55	70,55	69,51
Wasser			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen, per investierter Million EUR)	0,54	70,55	0,37
Abfall			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen, per investierter Million EUR)	2,31	70,55	21,61
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)	0,08	70,55	69,58
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)	26,50	70,55	69,34
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,39	70,55	15,27
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	21,56	70,55	65,72
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	70,55	69,49
Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen			
Umwelt			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	85,85	24,46	22,00
Soziales			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (absolut)	5	24,46	0,00
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstossen (relativ)	3,63	24,46	0,00
Indikatoren für Investitionen in Immobilien			
Fossile Brennstoffe			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
Energieeffizienz			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

* Wirkung: Der Wert stellt das nicht normalisierte Exposure gegenüber einem bestimmten PAI-Indikator auf Portfolioebene dar. Dies bedeutet, dass für die PAI-Werte die tatsächlichen Gewichtungen der Portfolioengagements genutzt werden.

** Infrage kommende Vermögenswerte: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios (einschliesslich Liquidität), für den der PAI anwendbar ist. Beispielsweise können vom Fonds gehaltene Staatsanleihen nicht anhand von PAI-Indikatoren gemessen werden, die auf ein Unternehmen, in das investiert wird, angewendet werden.

*** Datenabdeckung: Prozentsatz des AUM des gesamten Portfolios, für den Daten zu den PAI-Indikatoren verfügbar sind.

**** Kennzeichnet die Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind, einschliesslich Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von fossilen Brennstoffen.

***** Die Abdeckung des PAI 6 ist auf die neun klimaintensiven Sektoren gemäss der SFDR beschränkt.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

31.03.2024

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	2,49	Vereinigte Staaten von Amerika
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,90	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 4,500% / 15.02.2036	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,21	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,000% / 15.02.2025	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,12	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,375% / 15.05.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,07	Vereinigte Staaten von Amerika
ING GROEP NV / 4,625% / 06.01.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,96	Niederlande
KOMMUNALBANKEN AS / 2,125% / 11.02.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,94	Norwegen
VERIZON COMMUNICATIONS INC / 3,875% / 08.02.2029	J. Information und Kommunikation	0,93	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,625% / 15.08.2030	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,92	Vereinigte Staaten von Amerika
INTERNATIONAL FINANCE CORP / 2,125% / 07.04.2026	U. Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,92	Supranational
APPLE INC / 3,000% / 20.06.2027	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,92	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,250% / 15.11.2027	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,90	Vereinigte Staaten von Amerika
PEPSICO INC / 3,900% / 18.07.2032	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,82	Vereinigte Staaten von Amerika
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,79	Vereinigte Staaten von Amerika
VERIZON COMMUNICATIONS INC / 5,250% / 16.03.2037	J. Information und Kommunikation	0,78	Vereinigte Staaten von Amerika

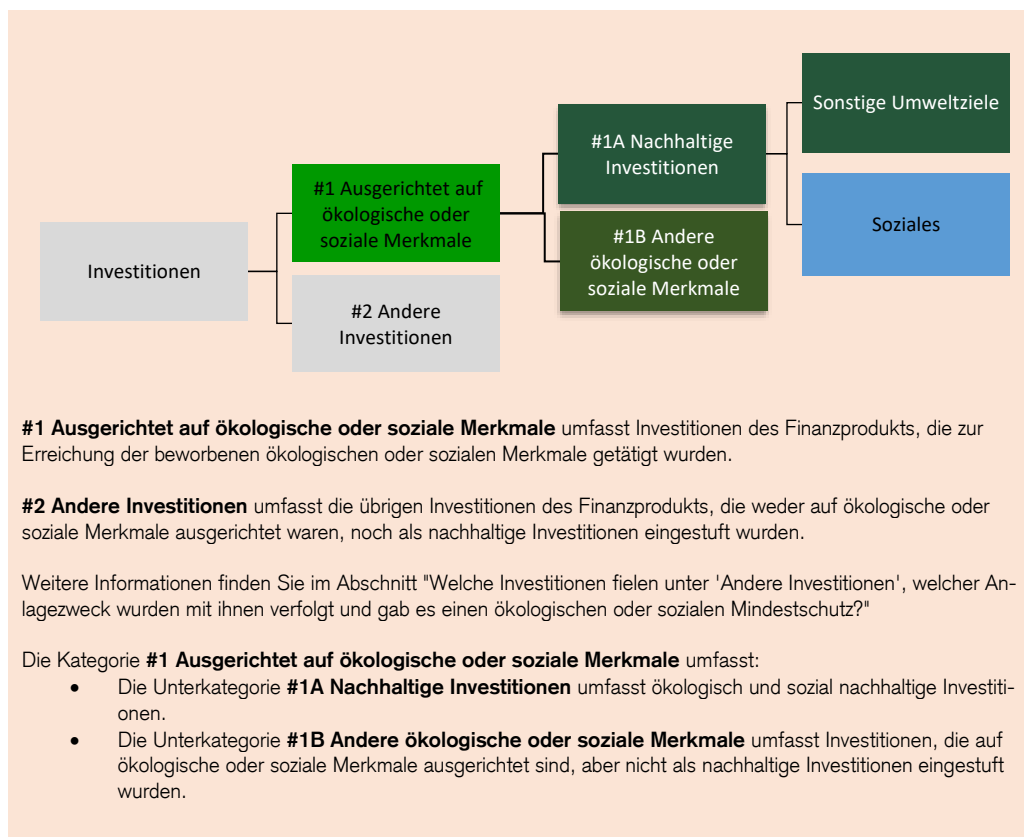
* Soweit möglich auf Look-through-Basis, ausgenommen Liquidität und Derivate. Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 90,67 % seines Gesamtnettvermögens.

In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 24,94 % seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A) und einen Anteil von 65,73 % seines Gesamtnettvermögens in anderen ökologischen/sozialen Merkmalen (Kategorie #1B oben).

Der Anteil dieses Subfonds in anderen Investitionen (Kategorie #2 oben), betrug 9,33 % seines Gesamtnettvermögens.

Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Subfondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,64%
C. Verarbeitendes Gewerbe	21,64%
D. Energieversorgung	1,90%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,14%
F. Baugewerbe	0,38%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,23%
H. Verkehr und Lagerei	1,94%
I. Gastgewerbe	0,49%

J. Information und Kommunikation	12,73%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	25,64%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,33%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,97%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,52%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	20,93%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,55%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,10%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,04%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	2,03%
Andere	1,77%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar. Die Kategorie "Andere" kann einen negativen Wert ausweisen. Dies kann durch negative eingegangene Liquiditätspositionen und den Einsatz bestimmter Arten von Derivaten (wie z. B. Devisen- oder OTC-Sicherheiten) aufgrund des Zeitpunkts der Transaktionsabwicklung verursacht werden.

Subfondsengagement 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	0,76%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,06%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,32%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,66%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,11%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,08%

* Bitte beachten Sie, dass die NACE-Sektorallokation bei der Anlagestrategie des Subfonds nicht verwendet wird. Sie wird ausschliesslich für die Zwecke der Information angegeben. Beispielsweise wird bei der Anlagestrategie des Subfonds gemäss dem CSAM-Rahmenwerk für ESG-Ausschlüsse das Kriterium Umsatzrisiko verwendet, und Unternehmen werden nicht auf Grundlage ihrer NACE-Sektorallokation ausgeschlossen.

** Portfolioengagement zum 31.03.2024. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Bezugszeitraum dar.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und den Umstieg auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Bei **Kernenergie** gehören zu den Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31.03.2024 meldete der Subfonds ein Engagement von 0,00 % in nachhaltigen Anlagen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel.

● *Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind¹?*

☐

Ja

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie

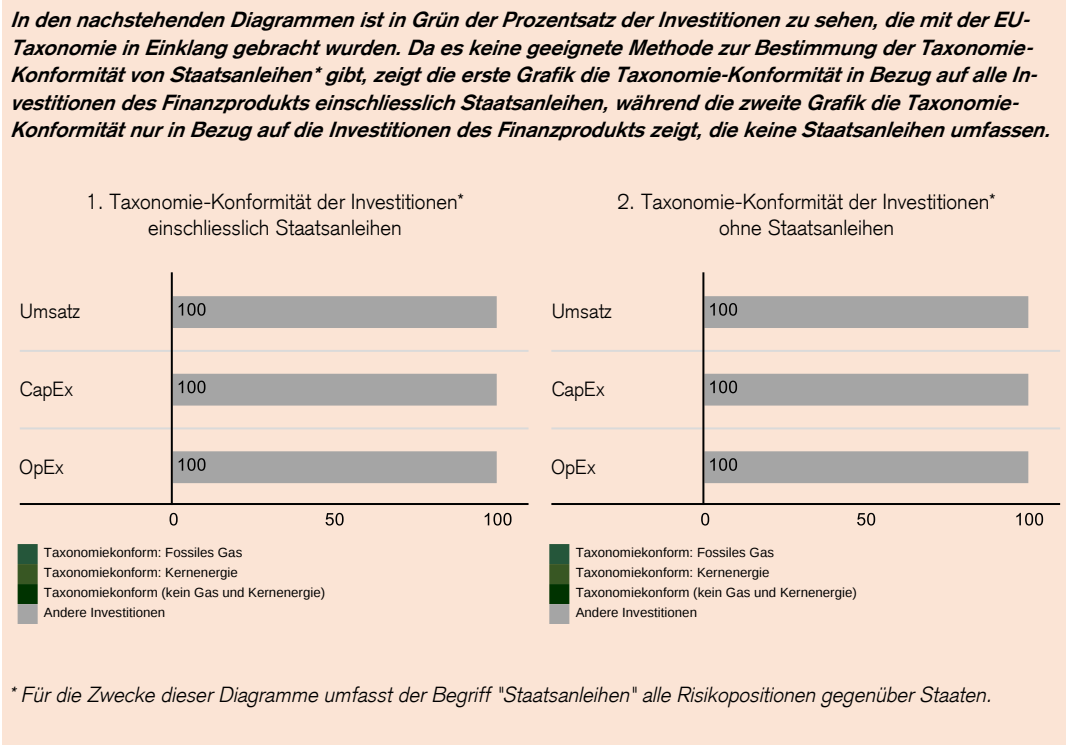
☒

Nein

¹ Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission niedergelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Die berichtete EU-Taxonomie-Konformität des Subfonds war nicht Gegenstand einer Bestätigung oder einer Überprüfung durch einen Dritten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Von den 0,00 % der nachhaltigen Investitionen mit einem mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel waren zum 31.03.2024 0,00 % in Übergangstätigkeiten und 0,00 % in ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Im vorangegangenen Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, zum 31.03.2023 bei 0,00%.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Zum 31.03.2024 waren 22,25 % der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2024 waren 2,69 % der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31.03.2024 waren 9,33 % der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

Anlagen wie z. B. Liquidität, Derivate und strukturierte Produkte können unter "Andere Investitionen" gefallen sein, da diese Instrumente nicht zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen dieses Subfonds beitrugen. Weitere Informationen über das Engagement des Portfolios in diesen Anlagen sind im Abschnitt Finanzen dieses Jahresberichts aufgeführt. Diese Anlagen hatten keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Sie wurden unter Umständen als Instrumente für die effiziente Portfolioverwaltung, für die Liquiditätssteuerung, für Absicherungszwecke oder als zusätzliche Renditequelle eingesetzt.

Darüber hinaus sind Anlagen unter Umständen unter "Andere Investitionen" gefallen, wenn unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Dies galt insbesondere für Anlageklassen, für die in unzureichender Weise ESG-Faktoren festgelegt wurden oder unzureichende ESG-bezogene Informationen zur Verfügung standen. Soweit möglich, wurde auf diese zugrunde liegenden Wertpapiere ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewendet, indem die Beachtung der ESG-Ausschlüsse von CSAM sichergestellt wurde.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die durch diesen Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, wendete dieser Subfonds ESG-Ausschlüsse und ESG-Integration sowie aktives Aktionärstum an.

Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die gegen internationale Verträge über umstrittene Waffen verstossen wie z. B. das Übereinkommen über Streumunition, das Übereinkommen über chemische Waffen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (NVV). Darüber hinaus schloss er Unternehmen aus, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) in Bezug auf Antipersonenminen, Streumunition und Kernwaffen (ausserhalb des NVV) zum Ausschluss empfohlen werden.

- Wertebasierte Ausschlüsse

Dieser Subfonds schloss Unternehmen aus, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielten. Er schloss Unternehmen aus, die mehr als 20% ihres Umsatzes aus dem Handel mit Tabakerzeugnissen und aus Hilfssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen erzielten. Darüber hinaus wurde eine Umsatzgrenze von 20% für Investitionen in Kohle (Kohlebergbau und Kohleverstromung) angewendet.

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

Unternehmen, bei denen systematische Verstösse gegen internationale Standards festgestellt wurden und bei denen die Verstösse besonders schwerwiegend waren oder sich die Unternehmensleitung der Umsetzung notwendiger Reformen verschloss, wurden auf eine Beobachtungsliste gesetzt und konnten aus dem gesamten Anlageuniversum von Credit Suisse ausgeschlossen werden. Dieser Prozess wurde durch einen eigens eingerichteten Ausschuss gesteuert, der die Liste der ausgeschlossenen Unternehmen führte und für die zeitnahe Übermittlung der Liste an die Anlageteams zuständig war.

Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Mitwirkung

CSAM wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wurde, um seinen Einfluss auf Nachhaltigkeitsaspekte zu vergrössern. Auf ausgewählte Unternehmen, die imstande und bereit waren, Massnahmen zu ergreifen, wurde über Engagement eingewirkt, und CSAM war bestrebt, den Wert der Unternehmen, in die investiert wurde, durch Engagement zu erhalten und/oder zu steigern. Das Team für aktives Aktionärstum bestimmte die Themen und Probleme, die CSAM mit diesen Unternehmen erörtern wollte. Die daraus resultierenden Engagementaktivitäten für den Bezugszeitraum dieses SFDR-Anhangs zum Jahresbericht wurden mithilfe bestimmter Kriterien festgelegt und zielten auf Unternehmen ab, an denen die CSAM über ihre Fonds erhebliche Beteiligungen hielt. Weitere Informationen über die Engagementaktivitäten und den aktuellen Bericht über das aktive Aktionärstum von CSAM finden Sie online auf: www.credit-suisse.com/esg.

- Stimmrechtsvertretung

Die Stimmrechte wurden für Unternehmen, in die investiert wird, ausgeübt, die die Kriterien für die Stimmrechtsvertretung, wie unter www.credit-suisse.com/esg erläutert, erfüllt haben.

Für Investitionen in Zielfonds von Dritten und CS ESG-Zielfonds wurden ESG-Faktoren in den folgenden vier Hauptschritten in den Anlageprozess integriert:

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Materiality frameworks are concepts that help to identify sustainability related issues and opportunities that are likely to affect the financial condition or operating performance of potential investee companies within an industry. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Direktanlagen in Aktien und festverzinsliche Anlagen:

- Bei Direktanlagen in festverzinslichen Anlagen wählte der Anlageverwalter nachhaltige Wertpapiere (z. B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) aus oder bewertete Wertpapiere hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren.
- Bei Direktanlagen in Aktien hat der Anlageverwalter die ESG-Integration angewandt, indem er das Anlageuniversum auf das eines ESG-Indexes beschränkt hat, wo dies möglich war, oder indem er Wertpapiere im Hinblick auf ihre ESG-Faktoren bewertet hat.

Anlagen in Zielfonds

- Bei Investitionen in indexnachbildende Zielfonds strebt der Anlageverwalter die Auswahl von ESG-Indizes (vollständige Replikation oder optimiertes Sampling) an, um die ESG-Integrationsmerkmale des Index zu erreichen.
- Bei Investitionen in aktive Aktien- oder festverzinsliche Zielfonds strebte der Anlageverwalter die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäß dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

Der Anlageverwalter strebte die Auswahl von Zielfonds an, die den Ansatz der "ESG-Integration", des "Sustainable Thematic" oder des "Impact Investing" gemäss dem im Credit Suisse Sustainable Investment Framework beschriebenen proprietären Klassifizierungssystem aufweisen.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachten die ESG-Faktoren regelmässig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der Zielfonds zu erkennen. Das Portfolio wurde regelmässig neu bewertet, wobei finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigt wurden und im Weiteren entschieden wurde, ob Positionen im Portfolio auf- oder abgebaut werden sollen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Der Subfonds verwendete keinen Referenzwert für die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Keine Angaben

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Keine Angaben

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Keine Angaben

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Keine Angaben



Teil des UBS-Konzerns

CREDIT SUISSE FUND MANAGEMENT S.A.
5, rue Jean Monnet
L-2180 Luxembourg
www.credit-suisse.com