

# CS Investment Funds 12

Investment Fund under Luxembourg law –

R.C.S. K671

Geprüfter Jahresbericht zum  
31.03.2023

## Inhaltsverzeichnis

<b>Verwaltung und Organe</b>	<b>3</b>
<b>Prüfungsvermerk</b>	<b>4</b>
<b>Kombinierter Bericht</b>	<b>10</b>
<b>Erläuterungen</b>	<b>12</b>
<b>Tätigkeitsbericht (ungeprüft)</b>	<b>15</b>
<b>Bericht per Subfonds</b>	
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	59
<b>Ungeprüfte Informationen</b>	<b>64</b>
Vergütung	64
Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")	64
Transparenz bei der Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen	66

## Verwaltung und Organe

### Verwaltungsgesellschaft

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

### Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

Thomas Nummer (bis zum 30.04.2023)  
Independent Director, Luxemburg

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

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

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

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

### Depotbank und Zahlstelle

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

### Zentrale Verwaltungsstelle

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

### Abschlussprüfer

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

### Anlageverwalter

Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG  
Kalandergerasse 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 EUR
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD

Co-Anlageverwalter:  
Credit Suisse (Italy) S.p.A.  
Societa di Gestione del Risparmio  
Via Santa Margherita, 3, I-20121 Milan  
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR

### Vertriebsstelle

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

### Vertreter in der Schweiz

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

### Zahlstelle in der Schweiz

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

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

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

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

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

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



To the Unitholders of  
**CS Investment Funds 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 2023, and of the results of their operations and changes in their net assets for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements.

#### *What we have audited*

The Fund's financial statements comprise:

- the Combined Statement of Net Assets for the Fund and the Statement of Net Assets for each of the sub-funds as at 31 March 2023;
- the 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 2023; and
- the notes to the financial statements, which include a summary of significant accounting policies.

---

#### **Basis for opinion**

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

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

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

---

#### **Other information**

The Board of Directors of the 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. However, future events or conditions may cause the Fund or any of its sub-funds to cease to continue as a going concern;
- evaluate the overall presentation, structure and content of the financial statements, including the disclosures, and whether the financial statements represent the underlying transactions and events in a manner that achieves fair presentation.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Represented by

Luxembourg, 20 July 2023

Sandra Paulis

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



An die Anteilinhaber des  
**CS Investment Funds 12**

---

### **Prüfungsurteil**

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der CS Investment Funds 12 und seiner jeweiligen Subfonds ("der Fonds") zum 31. März 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

*Was wir geprüft haben*

Der Abschluss des Fonds besteht aus:

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

---

### **Grundlage für das Prüfungsurteil**

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

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

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

---

### **Sonstige Informationen**

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

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



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

---

#### **Verantwortung des Verwaltungsrates der Verwaltungsgesellschaft für den Abschluss**

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

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

---

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

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

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

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



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

- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Anhangsangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, den 20. Juli 2023

Sandra Paulis

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

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

Wertpapierbestand zum Marktwert	3.560.727.964,62
Bareinlagen bei Banken und Brokern	48.583.979,45
Forderungen aus Erträgen	4.442.668,55
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	5.798.754,78
Andere Aktiva	44.379,47
	<b>3.619.597.746,87</b>

**Passiva**

Bankverbindlichkeiten und sonstige	722.018,92
Rückstellungen für Aufwendungen	4.817.030,34
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	140.830,66
Andere Passiva	3.781,67
	<b>5.683.661,59</b>

<b>Nettovermögen</b>	<b>3.613.914.085,28</b>
----------------------	-------------------------

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>4.623.321.205,49</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	14.075.956,65
Dividenden (Netto)	14.128.581,63
Bankzinsen	1.043.331,94
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	181.245,71
Andere Erträge	765.689,49
	<b>30.194.805,42</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	52.985.641,37
Depotbank- und Depotgebühr	2.507.346,32
Zentralverwaltungsvergütung	2.407.850,83
Druck- und Veröffentlichungskosten	272.578,92
Zinsen und Bankspesen	28.256,56
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	951.862,35
"Taxe d'abonnement"	956.115,92
	<b>60.109.652,27</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-29.914.846,85</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	20.060.440,33
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-60.104.415,82
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	3.022.168,41
	<b>-37.021.807,08</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-66.936.653,93</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-342.467.633,32
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	13.721.955,83
	<b>-328.745.677,49</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-395.682.331,42</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	239.732.645,71
Rücknahmen	-809.194.870,05
	<b>-569.462.224,34</b>
<b>Währungsdifferenz</b>	<b>-44.262.564,45</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>3.613.914.085,28</b>

## 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 31.03.2023 hatte der Fonds neun Subfonds aufgelegt.

## Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

### a) Darstellung des Abschlusses

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

### b) Berechnung des Nettoinventarwerts des jeweiligen Subfonds

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

Der Abschluss berücksichtigt die am 31.03.2023 berechneten Nettoinventarwerte.

Der Anlageverwalter muss Transaktionen ausführen, um die gewünschte Allokation nach Zeichnungen oder Rücknahmen aufrechtzuerhalten. Hierdurch können zusätzliche Kosten für den Subfonds und die Anteilinhaber entstehen. Um die Interessen der vorhandenen Anleger vor solchen Kapitalschwankungen zu schützen, wird daher eine Anpassung des verwendeten NIW pro Anteil vorgenommen, wenn die Netto-Kapitalschwankungen einen vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Grenzwert überschreiten. Diese Anpassung spiegelt die geschätzten Steuern und Handelskosten wider, die dem Subfonds durch diese Transaktionen entstehen können, sowie die geschätzte Geld-Brief-Spanne der Vermögenswerte, in die der Subfonds investiert. Es 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 Gesamtvermögen, das in der Aufstellung des Nettovermögens aufgeführt ist, das Gesamtvermögen 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 31.03.2023 wurde Swing-Pricing auf zwei Subfonds angewendet: Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR und Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD.

### 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 weniger als 6 Monate vor Abschluss aufgelegt wurden, wird keine TER ausgewiesen. 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 Wertpapierbestands 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 dem am 31.03.2023 geltenden Wechselkursen in CHF umgerechnet:

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

#### Fondsperformance

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

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

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

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

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

Die Performance 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	Wertpapierleihe Marktwert	Marktwert der Sicherheiten
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	1.157.328,00	1.216.828,20
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	2.664.302,00	2.801.278,30
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	366.208,00	385.035,38
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	135.067,00	142.011,02
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	490.619,00	515.842,56
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	67.020,00	70.465,61
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	8.049.694,00	8.463.542,47
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	5.623.279,00	5.912.381,34
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	217.434,00	228.612,65

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 31.03.2023 belief sich die an den Principal gezahlte Gebühr auf folgende Beträge:

## Erläuterungen

Subfonds	Währung	Aufwendungen Nettobetrag und des Ertrags		
		Bruttobetrag Wertpapierleihe	Provisionen von der Gegenpartei	aus der Wertpapierleihe
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	26.622,66	7.986,80	18.635,86
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	46.972,09	14.091,63	32.880,46
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	12.907,10	3.872,13	9.034,97
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	3.354,06	1.006,22	2.347,84
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	5.960,01	1.788,00	4.172,01
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	1.771,20	531,36	1.239,84
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	53.404,01	16.021,20	37.382,81
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	96.947,03	29.084,11	67.862,92
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	14.098,06	4.229,42	9.868,64

## Transaktionskosten

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

Subfonds	Währung	Transaktionskosten
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	83.293,77
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	177.938,31
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	97.593,62
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	40.114,77
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	56.010,95
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	53.777,61
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	79.043,73
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	122.194,83
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	66.200,38

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 31.03.2023 hatten die Fonds keine Sicherheiten angenommen, um das Gegenparteirisiko zu mindern.

## Nettoinventarwert ohne Anwendung des Swing-Pricing

In der folgenden Tabelle ist der Nettoinventarwert pro Anteil vor der Anpassung durch das Swing-Pricing (Nettoinventarwert ohne Anwendung des Swing-Pricing) aufgeführt für:

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR:

Aktienklasse	Währung	Nettoinventarwert je Aktie ohne Anwendung des Swing Pricing	Nettoinventarwert je Aktie nach Anwendung des Swing Pricing
B	EUR	190,26	189,95
IB	EUR	1.386,84	1.384,58
UB	EUR	114,94	114,75

Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD:

Aktienklasse	Währung	Nettoinventarwert je Aktie ohne Anwendung des Swing Pricing	Nettoinventarwert je Aktie nach Anwendung des Swing Pricing
B	USD	310,44	309,88
UB	USD	139,14	138,89
EB	USD	1.430,12	1.427,56
IB	USD	898,61	897,00
BH	JPY	10.702,00	10.683,00

## Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale

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

## Bedeutende Ereignisse während des Jahres

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

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

## Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Der neue Verkaufsprospekt trat im Mai 2023 in Kraft.

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

**Credit Suisse (Lux) 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 2022 bis zum 31. März 2023 war geprägt von dem anhaltenden Krieg in der Ukraine in Verbindung mit zunehmenden globalen wirtschaftlichen und politischen Spannungen sowie einem Anstieg der Inflationsraten, ausgelöst durch den Anstieg der Energiepreise. Gegen Ende des Berichtszeitraums scheint es jedoch so, als ob der Anstieg der Inflation und die Erhöhungen der Zentralbanken zur Eindämmung der Inflation weitestgehend abgeschlossen sind.

Gegenüber dem Jahr 2021 haben sich die Wachstumsraten des BIP in den grossen Volkswirtschaften verlangsamt. Diese Verlangsamung war vor allem auf die steigenden Energiekosten und den starken Anstieg der Inflationsraten zurückzuführen. Die Inflationsraten überstiegen in der Eurozone und im Vereinigten Königreich die 10 %-Marke und erreichten in den USA fast 10 %. Dies führte zu heftigen Reaktionen der Zentralbanken. Dennoch verzeichneten die USA ein starkes Beschäftigungswachstum, aber auch in der Eurozone war die Arbeitslosigkeit rückläufig. Insgesamt entwickelten sich die Unternehmensgewinne positiv, angetrieben von einem grossen Gewinnsprung im Energiesektor.

Die Renditen am Markt für langfristige Anleihen stiegen im zweiten und dritten Quartal 2022 sprunghaft an, bevor sie sich stabilisierten und bis zum Jahresende und im ersten Quartal 2023 nachgaben. In den USA hat sich die Renditekurve stark 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 im 2. und 3. Quartal 2022 negativ, bevor sie sich gegen Ende des Jahres zu erholen begannen und sich bis zum Ende des Berichtszeitraums ebenfalls positiv entwickelten.

Aufgrund des starken Anstiegs der Zinssätze tendierten auch die börsennotierten Immobilienanlagen nach unten. Rohstoffwerte verzeichneten eine negative Rendite.

Bei den Währungen kam es zunächst zu einem stärkeren USD und einem schwächeren EUR bis zum September und in der umgekehrten Entwicklung bis zum März 2023.

Anlagepolitik

Der Subfonds verzeichnete eine negative Performance.

Zu Beginn unseres Geschäftsjahres waren wir positiv gegenüber Aktien eingestellt. Angesichts der vielen politischen und wirtschaftlichen Unsicherheiten änderte sich dies im August zu einer vorsichtigeren Positionierung bei Aktien. Nachdem wir in den ersten Monaten des Geschäftsjahres eine negative Haltung gegenüber Staatsanleihen eingenommen hatten, begannen wir im Januar, Staatsanleihen gegenüber Unternehmensanleihen zu bevorzugen. Im Berichtszeitraum nahmen wir eine neutrale Gewichtung von Rohstoffen und börsennotierten globalen Immobilienwerten vor.

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%	1,93%
IB - Thesaurierend	EUR	1057476	LU0108835637	0,60%	1,03%
UB - Thesaurierend	EUR	26362612	LU1144411045	1,25%	1,68%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	EUR	3,54%	/	-14,20%	10,99%	2,95%
IB - Thesaurierend	EUR	3,78%	/	-13,43%	11,99%	3,88%
UB - Thesaurierend	EUR	3,61%	/	-13,99%	11,26%	3,21%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
<i>Gegenpartei</i>					
CAD	1.000.000	EUR	-680.581	12.05.2023	-1.718,26
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	390.000	EUR	-367.764	12.05.2023	-9.660,87
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.217.698	CAD	-1.760.000	12.05.2023	22.941,94
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	2.600.000	EUR	-2.409.020	12.05.2023	-21.664,28
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.520.000	EUR	-1.428.592	12.05.2023	-32.906,62
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	76.956.059	USD	-82.920.000	12.05.2023	819.745,48
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.300.000	EUR	-1.201.180	12.05.2023	-7.502,20
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.780.000	EUR	-1.668.470	12.05.2023	-34.049,74
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	2.500.000	EUR	-2.344.939	12.05.2023	-49.404,14
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.000.000	EUR	-933.289	12.05.2023	-15.074,76
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	212.000.000	EUR	-1.510.774	12.05.2023	-39.233,18
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften</b>					<b>631.473,37</b>

## Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR

**Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		327.391.672,69			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		5.339.663,45			
Forderungen aus Erträgen		338.823,78			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		631.473,37			
		<b>333.701.633,29</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		452.128,83			
		<b>452.128,83</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>333.249.504,46</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>EUR</b>	<b>333.249.504,46</b>	<b>427.772.671,03</b>	<b>443.048.893,52</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
B - Thesaurierend	EUR	189,95	203,82	200,24	
IB - Thesaurierend	EUR	1.384,58	1.472,35	1.433,53	
UB - Thesaurierend	EUR	114,75	122,82	120,36	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
B - Thesaurierend	EUR	1.274.643,731	1.514.007,029	67.418,840	306.782,138
IB - Thesaurierend	EUR	20.406,489	31.474,804	1.261,899	12.330,214
UB - Thesaurierend	EUR	543.157,623	593.088,073	58.739,086	108.669,536

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>427.772.671,03</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.110.244,69
Dividenden (Netto)	1.280.221,85
Bankzinsen	106.068,33
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	18.635,86
Andere Erträge	77.329,74
	<b>2.592.500,47</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	5.151.516,22
Depotbank- und Depotgebühr	234.592,48
Zentralverwaltungsvergütung	225.231,91
Druck- und Veröffentlichungskosten	24.522,01
Zinsen und Bankspesen	3.152,59
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	79.198,50
"Taxe d'abonnement"	75.562,29
	<b>5.793.776,00</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-3.201.275,53</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	10.721.309,04
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-9.798.441,90
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	566.434,34
	<b>1.489.301,48</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-1.711.974,05</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-30.629.667,15
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	3.688.820,20
	<b>-26.940.846,95</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-28.652.821,00</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	21.626.073,60
Rücknahmen	-87.496.419,17
	<b>-65.870.345,57</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>333.249.504,46</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Luxemburg	55,82
Vereinigte Staaten	11,56
Irland	11,55
Frankreich	4,18
Deutschland	2,80
Niederlande	2,67
Spanien	2,13
Italien	1,82
Supranational	1,29
Schweiz	1,03
Finnland	0,84
Australien	0,43
Belgien	0,37
Norwegen	0,32
Portugal	0,29
Polen	0,28
Kanada	0,27
Österreich	0,25
Mexiko	0,22
Niederländische Antillen	0,11
<b>Total</b>	<b>98,24</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	66,12
Länder und Zentralregierungen	4,92
Banken und andere Kreditinstitute	4,35
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,65
Energie- und Wasserversorgung	1,83
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,72
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	1,44
Telekommunikation	1,41
Supranationale Organisationen	1,29
Versicherungsgesellschaften	1,28
Elektronik und Halbleiter	1,08
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	1,08
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,01
Verkehr und Transport	0,85
Petroleum	0,77
Fahrzeuge	0,74
Elektrische Geräte und Komponenten	0,66
Computerhardware und Netzwerk	0,64
Chemie	0,59
Einzelhandel und Warenhäuser	0,55
Baustoffe und Bauindustrie	0,53
Grafikverlags- und Druckmedien	0,50
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,43
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,31
Immobilien	0,28
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,27
Fotografie und Optik	0,26
Verschiedene Konsumgüter	0,21
Gesundheits- und Sozialdienste	0,11
Biotechnologie	0,10
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,09
Uhrenindustrie, Schmuck	0,07
Edelmetalle und Edelsteine	0,05
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,05
<b>Total</b>	<b>98,24</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	6.885	217.614,56	0,07
USD ADOBE	949	336.615,70	0,10
EUR AIR LIQUIDE	9.760	1.504.992,00	0,45
CHF ALCON INC	1.095	71.381,86	0,02
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	6.650	1.415.120,00	0,42
USD ALPHABET A	9.950	949.987,11	0,29
USD ALPHABET C	9.210	881.623,64	0,26
USD AMERICAN EXPRESS	5.900	895.766,03	0,27
USD AMERICAN TOWER	1.730	325.379,17	0,10
USD AMGEN	1.540	342.671,08	0,10
EUR ASML HOLDING	4.100	2.563.320,00	0,77
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	842	172.538,51	0,05
EUR AXA	33.200	935.078,00	0,28
CHF BACHEM HOLDING LTD	66	6.077,98	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	10	19.536,52	0,01
CHF BKW	51	7.389,22	0,00
EUR BMW	4.660	470.380,40	0,14
EUR BNP PARIBAS A	18.400	1.015.864,00	0,30
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	6.140	391.700,86	0,12
USD CATERPILLAR	4.910	1.034.197,98	0,31
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	1.379	202.716,47	0,06
USD CISCO SYSTEMS	7.700	370.488,75	0,11
USD COCA-COLA	10.600	605.198,58	0,18
EUR CRH PLC	16.900	785.427,50	0,24
EUR DANONE	11.700	670.527,00	0,20
USD ECOLAB	1.290	196.542,59	0,06
USD ELEVANCE HEALTH	690	292.023,47	0,09
USD ELI LILLY & CO	2.320	733.337,38	0,22
EUR ENEL	89.000	500.803,00	0,15
EUR ESSILORLUXOTTICA	5.190	861.540,00	0,26
CHF GEBERIT	157	80.548,51	0,02
CHF GVAUDAN REG	42	125.809,57	0,04
USD HOME DEPOT	2.580	705.823,42	0,21
EUR IBERDROLA	68.367	785.195,00	0,24
USD IBM	1.680	202.707,17	0,06
EUR INDITEX	15.400	475.660,00	0,14
EUR ING GROUP	61.700	674.381,00	0,20
USD INTEL	7.630	229.437,25	0,07
USD INTUIT	498	204.356,70	0,06
USD JOHNSON & JOHNSON	6.870	980.118,74	0,29
EUR KERING	1.150	690.000,00	0,21
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	21.763,22	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	609	32.582,27	0,01
CHF LONZA REG	198	109.204,23	0,03
EUR L'OREAL	4.410	1.813.612,50	0,54
USD LOWE'S COMPANIES	1.560	287.130,75	0,09
EUR LVMH	3.910	3.301.604,00	0,99
USD MASTERCARD	1.600	535.188,92	0,16
USD MERCK & CO	7.280	712.889,87	0,21
USD MICROSOFT	14.400	3.821.179,07	1,15
USD MORGAN STANLEY	11.900	961.682,54	0,29
EUR NESTE OYJ	22.700	1.031.261,00	0,31
CHF NESTLE REG	6.821	766.013,76	0,23
USD NEWMONT MINING	3.660	165.137,10	0,05
USD NIKE B	2.610	294.620,46	0,09
CHF NOVARTIS REG	5.225	440.953,15	0,13
USD NUCOR	1.100	156.396,52	0,05
USD NVIDIA	5.050	1.291.121,08	0,39
EUR ORANGE	61.200	670.262,40	0,20
CHF PARTNERS GROUP	61	52.659,75	0,02
USD PEPSICO	3.270	548.687,01	0,16
USD PROCTER & GAMBLE	5.130	702.084,50	0,21
USD PROLOGIS	3.430	393.907,77	0,12
EUR REPSOL	62.200	882.307,00	0,26
CHF ROCHE HOLDING	57	15.793,45	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	1.809	475.625,74	0,14
USD S&P GLOBAL	3.150	999.609,28	0,30
USD SALESFORCE.COM	1.860	342.022,92	0,10
EUR SAP SE	10.500	1.218.630,00	0,37
USD SCHLUMBERGER	8.470	382.785,22	0,11
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	11.600	1.782.688,00	0,53
USD SEMPRA ENERGY	2.050	285.220,67	0,09
USD SHERWIN-WILLIAMS	1.030	213.091,35	0,06
CHF SIKA LTD	560	144.161,21	0,04
CHF SONOVA HOLDING REG	130	35.181,86	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	245	33.658,19	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	189	14.482,07	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	997	94.265,47	0,03
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	64	37.606,85	0,01
USD TARGET	1.160	176.842,74	0,05
USD TESLA MOTORS	6.100	1.164.808,32	0,35
USD TEXAS INSTRUMENTS	1.850	316.736,62	0,10
CHF THE SWATCH GROUP	55	17.367,25	0,01
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	921	488.597,51	0,15
USD TJX COS	2.660	191.852,00	0,06
CHF UBS GROUP	10.596	205.941,40	0,06
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	4.200	207.417,00	0,06
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	6.800	1.214.167,24	0,36
USD VALERO ENERGY	2.140	274.972,62	0,08
USD VERIZON COMMUNICATIONS	8.520	304.977,50	0,09
USD VISA A	2.760	572.754,94	0,17
USD WALT DISNEY	3.360	309.666,16	0,09
EUR WOLTERS KLUWER	5.680	660.868,00	0,20

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

**Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)**

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	496	218.739,75	0,07	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - QBX- USD	20.695	19.715.728,11	5,92
<b>Total Aktien</b>		<b>55.317.856,92</b>	<b>16,60</b>	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR	5.658	7.365.018,60	2,21
<b>Anleihen</b>				ACC- EUR			
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	2.000.000	1.819.660,00	0,55	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	7.394	7.236.675,85	2,17
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	1.500.000	1.335.634,41	0,40	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP	2.899	4.089.678,39	1,23
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	2.000.000	1.618.740,00	0,49	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX ACC- USD	3.796	4.222.296,62	1,27
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	900.000	844.137,00	0,25	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	5.481	4.267.340,68	1,28
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	1.500.000	1.297.197,29	0,39	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	3.470	4.880.229,46	1,46
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	2.000.000	1.789.560,00	0,54	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	14.042	14.412.679,33	4,32
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	1.450.000	1.246.869,50	0,37	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	1.611	2.808.295,73	0,84
EUR BNP PARIBAS 1.125%/19-280824	500.000	482.780,00	0,14	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	283	192.818,74	0,06
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	500.000	420.690,00	0,13	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	2.286	2.688.830,04	0,81
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	1.500.000	1.288.620,00	0,39	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	452	519.588,23	0,16
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	359.000	235.831,27	0,07	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	3.347	3.680.606,36	1,10
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	1.000.000	719.158,73	0,22	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	4.645	5.270.831,93	1,58
EUR DAIMLER AG 0.75%/20-10.09.2030	1.000.000	832.700,00	0,25	USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	11.269	9.945.181,63	2,98
EUR E.ON SE 0.875%/20-200831	1.500.000	1.204.800,00	0,36	USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	6.471	616.991,94	0,19
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	1.500.000	1.443.900,00	0,43	USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	83.288	8.098.434,64	2,43
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	600.000	526.025,13	0,16	USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	22.554	3.044.982,02	0,91
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-280728	2.000.000	1.989.300,00	0,60	<b>Total Fondsantheile (Open-End)</b>	<b>220.346.906,84</b>	<b>66,12</b>	
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.000.000	898.320,22	0,27	<b>Total Investmentfonds</b>	<b>220.346.906,84</b>	<b>66,12</b>	
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	2.000.000	1.614.300,00	0,48	<b>Total des Wertpapierbestandes</b>	<b>327.391.672,69</b>	<b>98,24</b>	
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	2.000.000	1.778.520,00	0,53	Bareinlagen bei Banken und Brokern	5.339.663,45	1,60	
EUR GERMANY 0.5%/15-150225	1.000.000	961.570,00	0,29	Anderere Nettovermögenswerte	518.168,32	0,16	
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	1.000.000	918.400,00	0,28	<b>Fondsvermögen</b>	<b>333.249.504,46</b>	<b>100,00</b>	
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	2.500.000	2.130.500,00	0,64				
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	1.000.000	874.702,01	0,26				
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	2.000.000	1.816.720,00	0,55				
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	1.500.000	1.231.326,80	0,37				
EUR KFW 2.75%/23-140233	2.000.000	1.986.460,00	0,60				
AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023	500.000	308.291,21	0,09				
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	850.000	752.564,32	0,23				
EUR NATURGY FINANCE 0.875%/17-150525	200.000	189.206,00	0,06				
EUR NEDER WATERSCHAPS BANK S. -1414- 1%/15-03.09.2025	1.000.000	948.980,00	0,28				
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	1.600.000	1.497.984,00	0,45				
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	500.000	477.120,00	0,14				
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	500.000	484.770,00	0,15				
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	2.000.000	1.571.300,00	0,47				
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	1.000.000	674.716,90	0,20				
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	1.000.000	919.950,00	0,28				
EUR TELEFONICA EMISIONES SAU 1.069%/19-05.02.2024	1.500.000	1.471.125,00	0,44				
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	1.000.000	808.744,07	0,24				
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	1.048.000	692.208,46	0,21				
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	1.273.000	733.140,33	0,22				
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	1.000.000	884.834,21	0,27				
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	500.000	445.706,92	0,13				
USD US TREASURY N/B 2.125%/17-290224	1.000.000	899.287,82	0,27				
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	800.000	692.795,34	0,21				
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	1.000.000	886.560,02	0,27				
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	1.000.000	858.803,33	0,26				
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	2.500.000	2.222.398,64	0,67				
<b>Total Anleihen</b>		<b>51.726.908,93</b>	<b>15,52</b>				
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>							
		<b>107.044.765,85</b>	<b>32,12</b>				
<b>Investmentfonds</b>							
<b>Fondsantheile (Open-End)</b>							
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	10.663	8.151.559,00	2,45				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	875	2.172.179,02	0,65				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	85.671	18.060.303,51	5,42				
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	5.517	6.589.605,32	1,98				
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	1.359	2.838.917,74	0,85				
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	3.310	6.427.666,90	1,93				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	282.211	37.392.957,50	11,22				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	168.236	23.998.541,38	7,20				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	5.242	741.874,84	0,22				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	264	216.794,26	0,07				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	13.025	10.700.299,07	3,21				

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

**Technische Daten und Erläuterungen****Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	CHF	672328	LU0078040838	1,50%	1,89%
IB - Thesaurierend	CHF	1057438	LU0108822734	0,60%	0,99%
UB - Thesaurierend	CHF	26362645	LU1144411128	1,25%	1,64%

**Fondsperformance**

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	CHF	2,68%	/	-16,12%	8,42%	2,52%
IB - Thesaurierend	CHF	2,91%	/	-15,36%	9,40%	3,45%
UB - Thesaurierend	CHF	2,74%	/	-15,91%	8,68%	2,78%

**Erläuterungen****Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In CHF)
<i>Gegenpartei</i>					
USD	3.400.000	CHF	-3.103.098	12.05.2023	-11.123,64
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
USD	660.000	CHF	-615.034	12.05.2023	-14.827,40
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.970.000	CHF	-2.753.255	12.05.2023	-52.324,75
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.000.000	CHF	-1.847.491	12.05.2023	-28.682,92
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	202.053.276	USD	-220.110.000	12.05.2023	1.892.848,62
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	3.874.219	CAD	-5.660.000	12.05.2023	68.993,54
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CAD	1.980.000	CHF	-1.332.708	12.05.2023	-1.456,56
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	900.000	CHF	-830.545	12.05.2023	-12.081,38
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.560.000	CHF	-2.359.176	12.05.2023	-31.100,83
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	9.814.960	EUR	-10.000.000	12.05.2023	-89.288,39
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	478.000.000	CHF	-3.370.315	12.05.2023	-84.239,94
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.500.000	CHF	-1.376.091	12.05.2023	-11.984,64
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CAD	2.250.000	CHF	-1.506.645	12.05.2023	6.141,07
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	4.860.000	CHF	-4.477.732	12.05.2023	-58.027,23
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.040.000	CHF	-964.999	12.05.2023	-19.218,95
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	37.461.826	EUR	-37.860.000	12.05.2023	-35.018,67
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	129.000.000	CHF	-904.046	12.05.2023	-17.218,52
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

**Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften****1.501.389,41**

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

**Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		888.054.580,06			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		11.762.997,02			
Forderungen aus Erträgen		834.262,42			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		1.501.389,41			
Andere Aktiva		5.778,00			
		<b>902.159.006,91</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		1.242.465,87			
Andere Passiva		10,36			
		<b>1.242.476,23</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>900.916.530,68</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>					
		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>CHF</b>	<b>900.916.530,68</b>	<b>1.076.494.069,83</b>	<b>1.098.418.285,53</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
B - Thesaurierend	CHF	200,68	222,12	223,73	
IB - Thesaurierend	CHF	1.387,50	1.521,94	1.519,26	
UB - Thesaurierend	CHF	111,37	122,96	123,54	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>					
		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
B - Thesaurierend	CHF	2.905.610,851	3.083.903,183	202.090,600	380.382,932
IB - Thesaurierend	CHF	10.526,106	8.551,478	4.592,189	2.617,561
UB - Thesaurierend	CHF	2.722.451,844	3.092.880,194	117.379,146	487.807,496

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>1.076.494.069,83</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.368.189,32
Dividenden (Netto)	4.529.718,16
Bankzinsen	252.497,49
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	32.880,46
Andere Erträge	166.375,48
	<b>7.349.660,91</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	13.578.322,94
Depotbank- und Depotgebühr	606.870,53
Zentralverwaltungsvergütung	582.653,79
Druck- und Veröffentlichungskosten	58.638,22
Zinsen und Bankspesen	6.038,71
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	156.797,44
"Taxe d'abonnement"	241.174,08
	<b>15.230.495,71</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-7.880.834,80</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	4.155.321,58
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-7.913.762,14
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	1.196.858,08
	<b>-2.561.582,48</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-10.442.417,28</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-91.493.183,34
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-377.044,43
	<b>-91.870.227,77</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-102.312.645,05</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	61.900.097,27
Rücknahmen	-135.164.991,37
	<b>-73.264.894,10</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>900.916.530,68</b>

## Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

## Geographische Aufteilung

Luxemburg	48,52
Schweiz	16,14
Vereinigte Staaten	10,74
Irland	9,52
Supranational	2,87
Deutschland	2,08
Niederlande	1,54
Kanada	0,95
Frankreich	0,91
Österreich	0,88
Australien	0,63
Spanien	0,54
Chile	0,50
Norwegen	0,50
Vereinigte Arabische Emirate	0,40
Finnland	0,36
Südkorea	0,36
Neuseeland	0,25
Italien	0,24
Schweden	0,21
Belgien	0,15
Niederländische Antillen	0,10
Mexiko	0,08
Polen	0,05
Portugal	0,05
<b>Total</b>	<b>98,57</b>

## Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	57,94
Banken und andere Kreditinstitute	8,81
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	5,83
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	4,28
Länder und Zentralregierungen	3,08
Supranationale Organisationen	3,03
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,96
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	1,88
Versicherungsgesellschaften	1,59
Elektrische Geräte und Komponenten	1,25
Chemie	1,25
Uhrenindustrie, Schmuck	1,02
Computerhardware und Netzwerk	0,75
Telekommunikation	0,66
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,63
Baustoffe und Bauindustrie	0,62
Verkehr und Transport	0,58
Gesundheits- und Sozialdienste	0,41
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,34
Energie- und Wasserversorgung	0,32
Elektronik und Halbleiter	0,31
Fahrzeuge	0,30
Grafikverlags- und Druckmedien	0,27
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,26
Immobilien	0,25
Petroleum	0,20
Einzelhandel und Warenhäuser	0,19
Verschiedene Konsumgüter	0,18
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,13
Biotechnologie	0,09
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,08
Edelmetalle und Edelsteine	0,04
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,04
Fotografie und Optik	0,01
<b>Total</b>	<b>98,57</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	290.994	9.128.481,78	1,01
USD ADOBE	2.190	770.979,43	0,09
EUR AIR LIQUIDE	1.490	228.034,82	0,03
CHF ALCON INC	46.194	2.988.751,80	0,33
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	1.020	215.428,08	0,02
USD ALPHABET A	23.000	2.179.480,49	0,24
USD ALPHABET C	21.300	2.023.642,14	0,22
USD AMERICAN EXPRESS	13.600	2.049.330,48	0,23
USD AMERICAN TOWER	4.000	746.679,37	0,08
USD AMGEN	3.550	783.999,18	0,09
EUR ASML HOLDING	628	383.990,91	0,04
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	1.950	399.587,54	0,04
EUR AXA	5.090	142.284,65	0,02
CHF BACHEM HOLDING LTD	2.756	251.898,40	0,03
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	374	725.186,00	0,08
CHF BKW	2.200	316.360,00	0,04
EUR BMW	714	71.530,63	0,01
EUR BNP PARIBAS A	2.820	154.524,51	0,02
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	14.200	899.093,82	0,10
USD CATERPILLAR	11.300	2.362.278,81	0,26
CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI	11	1.188.900,00	0,13
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	58.193	8.490.358,70	0,94
USD CISCO SYSTEMS	17.800	850.031,10	0,09
USD COCA-COLA	24.500	1.388.316,98	0,15
EUR CRH PLC	2.590	119.467,47	0,01
EUR DANONE	1.790	101.815,51	0,01
USD ECOLAB	2.980	450.623,41	0,05
USD ELEVANCE HEALTH	1.590	667.876,72	0,07
USD ELI LILLY & CO	5.360	1.681.555,26	0,19
EUR ENEL	13.600	75.953,23	0,01
EUR ESSLORLUXOTTICA	795	130.980,23	0,01
CHF GEBERIT	6.637	3.379.560,40	0,38
CHF GIVAUDAN REG	1.797	5.342.481,00	0,59
USD HOME DEPOT	5.960	1.606.814,24	0,18
EUR IBERDROLA	10.330	117.750,25	0,01
USD IBM	3.880	464.645,85	0,05
EUR INDITEX	2.350	72.070,39	0,01
EUR ING GROUP	9.450	102.513,84	0,01
USD INTEL	17.600	525.269,97	0,06
USD INTUIT	1.150	468.368,74	0,05
USD JOHNSON & JOHNSON	15.900	2.251.384,10	0,25
EUR KERING	176	104.808,00	0,01
CHF LINDT & SPRUENGLI	99	1.069.200,00	0,12
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	25.739	1.366.740,90	0,15
CHF LONZA REG	8.260	4.521.524,00	0,50
USD L'OREAL	676	275.919,96	0,03
USD LOWE'S COMPANIES	3.610	659.466,62	0,07
EUR LVMH	599	502.002,13	0,06
USD MASTERCARD	3.700	1.228.342,19	0,14
USD MERCK & CO	16.800	1.632.791,99	0,18
USD MICROSOFT	33.200	8.743.866,08	0,97
USD MORGAN STANLEY	27.500	2.205.707,81	0,24
EUR NESTE OYJ	3.480	156.910,68	0,02
CHF NESTLE REG	288.112	32.112.963,52	3,56
USD NEWMONT MINING	8.460	378.847,51	0,04
USD NIKE B	6.020	674.449,45	0,07
CHF NOVARTIS REG	219.926	18.421.001,76	2,04
USD NUCOR	2.540	358.425,28	0,04
USD NVIDIA	11.700	2.968.875,40	0,33
EUR ORANGE	9.370	101.850,59	0,01
CHF PARTNERS GROUP	2.642	2.263.665,60	0,25
USD PEPSICO	7.550	1.257.344,90	0,14
USD PROCTER & GAMBLE	11.900	1.616.402,43	0,18
USD PROLOGIS	7.920	902.726,37	0,10
EUR REPSOL	9.520	134.028,39	0,01
CHF ROCHE HOLDING	2.469	678.975,00	0,08
CHF ROCHE HOLDING CERT	76.350	19.923.532,50	2,21
USD S&P GLOBAL	7.280	2.292.881,55	0,25
USD SALESFORCE.COM	4.290	782.942,87	0,09
EUR SAP SE	1.600	184.303,28	0,02
USD SCHLUMBERGER	19.600	879.140,60	0,10
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	1.780	271.498,77	0,03
USD SEMPRA ENERGY	4.740	654.539,70	0,07
USD SHERWIN-WILLIAMS	2.390	490.746,28	0,05
CHF SIKA LTD	23.626	6.036.443,00	0,67
CHF SONOVA HOLDING REG	5.456	1.465.481,60	0,16
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	10.276	1.401.132,60	0,16
CHF SWISS PRIME SITE	7.992	607.791,60	0,07
CHF SWISS REINSURANCE	42.065	3.947.379,60	0,44
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	2.699	1.574.066,80	0,17
USD TARGET	2.680	405.503,46	0,05
USD TESLA MOTORS	14.100	2.672.232,60	0,30
USD TEXAS INSTRUMENTS	4.290	727.278,64	0,08
CHF THE SWATCH GROUP	2.344	734.609,60	0,08
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	2.130	1.121.506,36	0,12
USD TJX COS	6.140	439.524,99	0,05
CHF UBS GROUP	428.327	8.262.427,83	0,92
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	643	31.516,40	0,00
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	15.700	2.782.273,16	0,31
USD VALERO ENERGY	4.950	631.264,53	0,07
USD VERIZON COMMUNICATIONS	19.700	699.882,19	0,08
USD VISA A	6.380	1.314.047,16	0,15
USD WALT DISNEY	7.760	709.817,51	0,08

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 Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermögens
EUR WOLTERS KLUWER	871	100.580,79	0,01	CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.3%/17-31.10.2025	1.000.000	950.000,00	0,11
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	21.033	9.206.144,10	1,02	EUR NEDER WATERSCHAPS BANK S. -1414- 1%/15-03.09.2025	1.000.000	941.862,65	0,10
<b>Total Aktien</b>		<b>210.987.386,78</b>	<b>23,42</b>	CHF NETHERLANDS 0.5%/16-150726	350.000	325.226,37	0,04
<b>Anleihen</b>				CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028	5.500.000	4.955.500,00	0,55
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	5.000.000	4.997.500,00	0,55	CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025	1.500.000	1.444.500,00	0,16
CHF AFRICA FINANCE CORP 1.205%/20-30.09.2025	4.500.000	4.275.000,00	0,47	EUR OBRIGACÕES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	250.000	236.770,80	0,03
CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025	2.000.000	1.914.000,00	0,21	EUR OBRIGACÕES DO TESOURO 2.125%/18-171028	250.000	240.567,11	0,03
CHF ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 0.25%/16-25.10.2023	1.000.000	989.300,00	0,11	EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	1.000.000	779.757,63	0,09
CHF APPLE 0.375%/15-25.11.2024	1.000.000	977.000,00	0,11	CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	1.000.000	669.656,53	0,07
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	3.000.000	2.651.234,30	0,29	CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029	500.000	454.500,00	0,05
EUR ASIAN DEVELOPMENT BANK 0%/19-24.10.2029	1.000.000	822.117,53	0,09	EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	500.000	456.525,19	0,05
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	1.000.000	803.299,73	0,09	USD ROYAL BANK OF CANADA S H 1.15%/21-140726	2.000.000	1.640.472,92	0,18
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	2.000.000	1.716.624,42	0,19	EUR SPAIN 1.6%/14-300425	300.000	290.458,10	0,03
CHF BANCO BILBAO SA 2.4075%/22-281125	2.000.000	1.996.000,00	0,22	EUR SPAIN 2.75%/14-311024	250.000	247.589,05	0,03
CHF BANCO DE CREDITO E 0.5994%/22-260427	5.000.000	4.510.000,00	0,50	CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 2.7%/23-200329	3.600.000	3.603.600,00	0,40
CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	1.500.000	1.315.500,00	0,15	USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	2.000.000	1.605.356,99	0,18
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025	1.000.000	870.233,72	0,10	AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	3.000.000	1.966.651,41	0,22
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.1425%/21-251028	500.000	434.750,00	0,05	AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	3.130.000	1.789.095,66	0,20
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027	1.750.000	1.615.250,00	0,18	USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	3.500.000	3.073.692,85	0,34
CHF BAWAG P.S.K. 2.955%/22-291127	7.000.000	7.045.500,00	0,78	USD US 4.5%/06-15.02.2036	3.000.000	3.044.609,88	0,34
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	500.000	426.730,34	0,05	USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	2.000.000	1.769.456,46	0,20
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	1.000.000	920.643,00	0,10	USD US TREASURY N/B 2.125%/17-290224	1.500.000	1.338.814,74	0,15
CHF BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028	1.000.000	891.500,00	0,10	USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	2.000.000	1.718.998,45	0,19
CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	1.500.000	1.412.250,00	0,16	USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	3.000.000	2.639.732,45	0,29
CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LB) 11%/20-24.07.2028	1.500.000	1.305.750,00	0,14	USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	3.000.000	2.557.086,92	0,28
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	250.000	208.767,41	0,02	USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	3.000.000	2.233.570,34	0,25
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	250.000	213.159,23	0,02	USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	4.000.000	3.529.169,04	0,39
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	300.000	275.549,76	0,03	<b>Total Anleihen</b>	<b>155.035.716,76</b>	<b>17,21</b>	
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	3.000.000	1.955.954,35	0,22	<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>	<b>366.023.103,54</b>	<b>40,63</b>	
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-150229	500.000	442.248,08	0,05	<b>Investmentfonds</b>			
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	1.000.000	914.500,00	0,10	<b>Fondsanteile (Open-End)</b>			
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.1%/20-24.10.2023	1.035.000	1.024.857,00	0,11	USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	28.778	21.834.959,51	2,42
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025	1.500.000	1.422.750,00	0,16	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	1.157	2.852.576,00	0,32
CHF CENTRAL AMER BANK 0.11%/21-151228	5.000.000	4.347.500,00	0,48	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	78.099	16.340.569,81	1,81
CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028	1.000.000	894.500,00	0,10	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	14.966	17.743.081,57	1,97
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	1.000.000	713.765,04	0,08	USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	2.564	5.314.193,42	0,59
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	1.000.000	936.000,00	0,10	USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	6.916	13.329.408,21	1,48
CHF COOPERATIVE RABOBANK UA 0.25%/19-25.11.2027	2.600.000	2.310.100,00	0,26	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	188.500	24.788.928,13	2,75
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	1.000.000	1.024.000,00	0,11	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	360.797	51.060.994,68	5,67
CHF CORPORACION ANDINA 0.45%/22-240227	5.000.000	4.612.500,00	0,51	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	51.798	7.275.739,36	0,81
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026	2.000.000	1.886.000,00	0,21	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	592	481.407,25	0,05
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.1637%/21-280428	1.500.000	1.329.000,00	0,15	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	34.083	27.788.920,51	3,08
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.5%/18-18.07.2028	2.000.000	1.847.000,00	0,21	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD	54.862	51.874.157,07	5,76
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	1.500.000	1.305.199,85	0,15	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	7.306	9.438.893,55	1,05
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	2.000.000	1.615.296,15	0,18	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	17.480	16.979.762,73	1,88
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-280728	1.750.000	1.727.582,72	0,19	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	7.567	10.594.859,23	1,18
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.000.000	891.582,82	0,10	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	8.092	8.933.238,42	0,99
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	3.000.000	2.403.289,13	0,27	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	14.447	11.163.636,89	1,24
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	370.000	326.969,80	0,04	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	8.260	11.529.788,23	1,28
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	1.500.000	1.323.885,83	0,15	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	47.631	48.521.695,75	5,39
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	4.000.000	3.608.000,00	0,40	CHF CS INVESTMENT FUNDS 14 - CREDIT SUISSE (LUX) SWISS FRANC BOND FUND -EB- USD	500.000	57.185.000,00	6,35
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	500.000	452.029,16	0,05	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -EB- USD	4.122	7.131.580,73	0,79
EUR FRANCE OAT 1.75%/13-250523	500.000	495.624,73	0,06	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	674	455.777,85	0,05
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	500.000	414.155,36	0,05				
EUR GERMANY 0.25%/17-150227	1.000.000	915.879,00	0,10				
EUR GERMANY 1%/14-150824	1.000.000	969.622,88	0,11				
EUR GERMANY 1.5%/13-150523	200.000	198.279,67	0,02				
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029	1.000.000	840.000,00	0,09				
CHF HYUNDAI CAPIT SRV INC 3.0325%/23-010228	3.230.000	3.260.685,00	0,36				
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	1.000.000	899.064,59	0,10				
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	1.500.000	1.367.268,00	0,15				
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	1.500.000	1.268.712,75	0,14				
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	1.500.000	1.302.212,62	0,14				
EUR KFW 0.01%/19-05.05.2027	500.000	442.074,39	0,05				
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	2.000.000	1.629.455,80	0,18				
EUR KFW 2.75%/23-140233	2.000.000	1.971.561,55	0,22				
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	1.000.000	878.729,51	0,10				
CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027	1.500.000	1.371.000,00	0,15				
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028	7.000.000	6.125.000,00	0,68				
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.1%/20-17.12.2025	3.000.000	2.811.000,00	0,31				
CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	1.500.000	1.470.000,00	0,16				

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 Nettovermö- gens
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EB- USD ACC- USD	4.972	5.804.285,43	0,64
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	11.183	12.758.796,53	1,42
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	8.982	9.803.185,62	1,09
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	13.528	15.235.529,76	1,69
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	30.636	26.834.278,11	2,98
USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	17.399	1.646.504,39	0,18
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	217.021	20.943.580,19	2,32
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	47.510	6.366.147,59	0,71
<b>Total Fondsanteile (Open-End)</b>		<b>522.031.476,52</b>	<b>57,94</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>522.031.476,52</b>	<b>57,94</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>888.054.580,06</b>	<b>98,57</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		11.762.997,02	1,31
Andere Nettovermögenswerte		1.098.953,60	0,12
<b>Fondsvermögen</b>		<b>900.916.530,68</b>	<b>100,00</b>

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%	1,92%
EB - Thesaurierend	USD	28145643	LU1230136977	0,60%	1,00%
IB - Thesaurierend	USD	1057436	LU0108835801	0,60%	1,01%
UB - Thesaurierend	USD	26362734	LU1144411391	1,25%	1,67%
BH - Thesaurierend	JPY	36829019	LU1614284856	1,50%	2,00%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	USD	4,35%	/	-16,59%	8,64%	10,13%
EB - Thesaurierend	USD	4,59%	/	-15,82%	9,64%	11,14%
IB - Thesaurierend	USD	4,59%	/	-15,84%	9,62%	11,12%
UB - Thesaurierend	USD	4,42%	/	-16,38%	8,91%	10,40%
BH - Thesaurierend	JPY	3,04%	/	-18,76%	8,16%	8,70%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
JPY	14.850.400	USD	-111.859	13.04.2023	-70,76
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
JPY	2.384.370.700	USD	-17.663.209	13.04.2023	285.390,07
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	889.432	JPY	-115.882.800	13.04.2023	17.080,66
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
JPY	2.343.069.700	USD	-17.805.128	26.04.2023	-134.254,36
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CAD	250.000	USD	-182.480	12.05.2023	2.352,34
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.014.214	CAD	-1.360.000	12.05.2023	8.720,87
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	185.000.000	USD	-1.420.700	12.05.2023	-22.193,77
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	42.000.000	USD	-322.477	12.05.2023	-4.978,65
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CAD	850.000	USD	-619.824	12.05.2023	8.606,20
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	3.432.065	EUR	-3.190.000	12.05.2023	-41.970,06
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	8.471.837	EUR	-7.860.000	12.05.2023	-88.049,09
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften</b>					<b>30.633,45</b>

**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		314.673.405,98			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		5.113.157,74			
Forderungen aus Erträgen		363.241,82			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		30.633,45			
Andere Aktiva		2.576,64			
		<b>320.183.015,63</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		432.085,32			
		<b>432.085,32</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>319.750.930,31</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>					
		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>USD</b>	<b>319.750.930,31</b>	<b>428.069.419,28</b>	<b>378.870.913,07</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
B - Thesaurierend	USD	311,29	339,12	334,11	
EB - Thesaurierend	USD	1.324,03	1.429,19	1.395,17	
IB - Thesaurierend	USD	1.439,13	1.553,75	1.517,11	
UB - Thesaurierend	USD	127,75	138,82	136,43	
BH - Thesaurierend	JPY	10.345,00	11.706,00	11.580,00	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>					
		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
B - Thesaurierend	USD	567.898,613	712.726,480	58.988,252	203.816,119
EB - Thesaurierend	USD	9.604,959	11.759,403	669,076	2.823,520
IB - Thesaurierend	USD	28.257,318	38.502,338	2.071,794	12.316,814
UB - Thesaurierend	USD	422.353,542	474.764,418	112.291,751	164.702,627
BH - Thesaurierend	JPY	458.405,323	454.481,590	86.705,645	82.781,912

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>428.069.419,28</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.626.806,48
Dividenden (Netto)	806.057,97
Bankzinsen	111.092,55
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	9.034,97
Andere Erträge	75.445,89
	<b>2.628.437,86</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	4.678.384,57
Depotbank- und Depotgebühr	223.256,02
Zentralverwaltungsvergütung	214.333,25
Druck- und Veröffentlichungskosten	25.364,52
Zinsen und Bankspesen	374,09
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	134.911,19
"Taxe d'abonnement"	81.859,68
	<b>5.358.483,32</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-2.730.045,46</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.254.357,09
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-5.786.893,27
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-636.400,28
	<b>-9.677.650,64</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-12.407.696,10</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-32.112.882,58
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	1.940.579,59
	<b>-30.172.302,99</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-42.579.999,09</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	42.782.399,57
Rücknahmen	-108.520.889,45
	<b>-65.738.489,88</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>319.750.930,31</b>

## Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

## Geographische Aufteilung

Luxemburg	48,67
Vereinigte Staaten	21,49
Irland	19,28
Supranational	1,48
Niederlande	1,41
Australien	0,99
Schweiz	0,87
Frankreich	0,79
Deutschland	0,78
Norwegen	0,53
Mexiko	0,49
Spanien	0,37
Italien	0,25
Finnland	0,24
Kanada	0,21
Niederländische Antillen	0,17
Belgien	0,14
Polen	0,11
Österreich	0,08
Portugal	0,07
<b>Total</b>	<b>98,41</b>

## Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	67,71
Länder und Zentralregierungen	7,63
Banken und andere Kreditinstitute	4,15
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	3,40
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,60
Supranationale Organisationen	1,48
Telekommunikation	1,23
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,23
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	1,21
Computerhardware und Netzwerk	1,11
Energie- und Wasserversorgung	0,92
Verkehr und Transport	0,60
Elektronik und Halbleiter	0,57
Fahrzeuge	0,53
Grafikverlags- und Druckmedien	0,47
Baustoffe und Bauindustrie	0,46
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,45
Petroleum	0,38
Einzelhandel und Warenhäuser	0,34
Immobilien	0,33
Elektrische Geräte und Komponenten	0,32
Verschiedene Konsumgüter	0,31
Versicherungsgesellschaften	0,30
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,28
Chemie	0,22
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,21
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,21
Biotechnologie	0,15
Gesundheits- und Sozialdienste	0,15
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,14
Hypotheken- und Finanzierungsanstalten (MBS, ABS)	0,08
Edelmetalle und Edelsteine	0,07
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,07
Uhrenindustrie, Schmuck	0,06
Fotografie und Optik	0,04
<b>Total</b>	<b>98,41</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	5.116	175.680,79	0,05
USD ADOBE	1.230	474.005,10	0,15
EUR AIR LIQUIDE	1.330	222.815,68	0,07
CHF ALCON INC	812	57.508,49	0,02
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	905	209.232,89	0,07
USD ALPHABET A	12.900	1.338.117,00	0,42
USD ALPHABET C	11.900	1.237.600,00	0,39
USD AMERICAN EXPRESS	7.620	1.256.919,00	0,39
USD AMERICAN TOWER	2.240	457.721,60	0,14
USD AMGEN	1.990	481.082,50	0,15
EUR ASML HOLDING	558	379.020,69	0,12
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	1.090	242.666,70	0,08
EUR AXA	4.520	138.311,39	0,04
CHF BACHEM HOLDING LTD	48	4.302,49	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	7	14.857,82	0,00
CHF BKW	38	5.981,66	0,00
EUR BMW	634	69.528,41	0,02
EUR BNP PARIBAS A	2.500	149.957,26	0,05
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	7.930	549.628,30	0,17
USD CATERPILLAR	6.340	1.450.845,60	0,45
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	1.023	163.384,24	0,05
USD CISCO SYSTEMS	9.940	519.613,50	0,16
USD COCA-COLA	13.700	849.811,00	0,27
EUR CRH PLC	2.300	116.133,36	0,04
EUR DANONE	1.590	99.000,47	0,03
USD ECOLAB	1.670	276.435,10	0,09
USD ELEVANCE HEALTH	891	409.690,71	0,13
USD ELI LILLY & CO	3.000	1.030.260,00	0,32
EUR ENEL	12.100	73.972,80	0,02
EUR ESSILORLUXOTTICA	706	127.327,59	0,04
CHF GEBERIT	117	65.215,90	0,02
CHF GNAUDAN REG	31	100.887,14	0,03
USD HOME DEPOT	3.330	982.749,60	0,31
EUR IBERDROLA	9.218	115.021,08	0,04
USD IBM	2.170	284.465,30	0,09
EUR INDITEX	2.090	70.164,03	0,02
EUR ING GROUP	6.390	99.630,40	0,03
USD INTEL	9.860	322.126,20	0,10
USD INTUIT	643	286.668,69	0,09
USD JOHNSON & JOHNSON	8.870	1.374.850,00	0,43
EUR KERING	157	102.343,59	0,03
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	23.644,65	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	452	26.273,15	0,01
CHF LONZA REG	148	88.684,09	0,03
EUR L'OREAL	600	268.081,54	0,08
USD LOWE'S COMPANIES	2.020	403.939,40	0,13
EUR LVMH	532	498.065,94	0,15
USD MASTERCARD	2.070	752.258,70	0,24
USD MERCK & CO	9.410	1.001.129,90	0,31
USD MICROSOFT	18.600	5.362.380,00	1,68
USD MORGAN STANLEY	15.400	1.352.120,00	0,42
EUR NESTLE OYJ	3.090	152.514,44	0,05
CHF NESTLE REG	5.063	617.740,67	0,19
USD NEWMONT MINING	4.740	232.354,80	0,07
USD NIKE B	3.370	413.296,80	0,13
CHF NOVARTIS REG	3.863	354.193,52	0,11
USD NUCOR	1.420	219.347,40	0,07
USD NVIDIA	6.520	1.811.060,40	0,57
EUR ORANGE	8.320	98.998,02	0,03
CHF PARTNERS GROUP	47	44.081,52	0,01
USD PEPSICO	4.220	769.306,00	0,24
USD PROCTER & GAMBLE	6.640	987.301,60	0,31
USD PROLOGIS	4.430	552.731,10	0,17
EUR REPSOL	8.450	130.225,43	0,04
CHF ROCHE HOLDING	43	12.944,35	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	1.343	383.629,98	0,12
USD S&P GLOBAL	4.070	1.403.213,90	0,44
USD SALESFORCE.COM	2.400	479.472,00	0,15
EUR SAP SE	1.420	179.052,61	0,06
USD SCHLUMBERGER	10.900	535.190,00	0,17
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	1.580	263.805,70	0,08
USD SEMPRA ENERGY	2.650	400.574,00	0,13
USD SHERWIN-WILLIAMS	1.340	301.191,80	0,09
CHF SIKA LTD	416	116.349,22	0,04
CHF SONOVA HOLDING REG	95	27.932,44	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	181	27.015,50	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	141	11.738,09	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	739	75.912,22	0,02
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	47	30.005,07	0,01
USD TARGET	1.500	248.445,00	0,08
USD TESLA MOTORS	7.890	1.636.859,40	0,51
USD TEXAS INSTRUMENTS	2.390	444.563,90	0,14
CHF THE SWATCH GROUP	41	14.065,72	0,00
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	1.190	685.880,30	0,21
USD TJX COS	3.440	269.558,40	0,08
CHF UBS GROUP	7.535	159.108,99	0,05
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	571	30.636,63	0,01
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	8.790	1.705.172,10	0,53
USD VALERO ENERGY	2.770	386.692,00	0,12
USD VERIZON COMMUNICATIONS	11.000	427.790,00	0,13
USD VISA A	3.570	804.892,20	0,25
USD WALT DISNEY	4.340	434.564,20	0,14
EUR WOLTERS KLUWER	773	97.713,74	0,03

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
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	369	176.799,95	0,06
<b>Total Aktien</b>		<b>44.306.523,55</b>	<b>13,86</b>
<b>Anleihen</b>			
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	2.500.000	2.418.500,00	0,76
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	1.000.000	970.430,00	0,30
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	400.000	351.736,01	0,11
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	250.000	254.753,51	0,08
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	2.500.000	2.348.900,00	0,73
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	300.000	291.640,12	0,09
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	200.000	186.849,84	0,06
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	250.000	251.947,76	0,08
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	100.000	91.411,73	0,03
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	100.000	100.544,43	0,03
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	700.000	499.591,14	0,16
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-150229	250.000	242.055,63	0,08
EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05%/17-010827	150.000	153.776,13	0,05
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	2.000.000	1.562.660,00	0,49
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	500.000	522.908,39	0,16
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	1.000.000	952.500,00	0,30
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	1.000.000	884.100,00	0,28
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.000.000	975.980,00	0,31
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	250.000	219.232,03	0,07
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	150.000	145.103,00	0,05
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	500.000	483.068,26	0,15
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	400.000	395.854,58	0,12
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	150.000	136.007,79	0,04
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL 1.125%/16-21.04.2026	300.000	306.880,84	0,10
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	2.500.000	2.460.425,00	0,77
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	500.000	498.897,84	0,16
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	250.000	231.468,17	0,07
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	1.000.000	950.320,00	0,30
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	500.000	493.443,86	0,15
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	2.000.000	1.783.700,00	0,56
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	1.500.000	1.442.865,00	0,45
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	2.500.000	2.491.975,00	0,78
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	150.000	152.576,69	0,05
EUR OBRIGACOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	100.000	103.673,40	0,03
EUR OBRIGACOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	100.000	105.335,67	0,03
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	200.000	170.713,89	0,05
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	250.000	183.261,55	0,06
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	350.000	349.817,89	0,11
EUR SPAIN 1.6%/14-300425	250.000	264.960,71	0,08
EUR SPAIN 2.75%/14-311024	100.000	108.410,33	0,03
EUR SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT 0.5%/18-30.01.2025	250.000	257.833,60	0,08
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	3.000.000	2.635.980,00	0,82
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	500.000	358.802,42	0,11
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	499.000	312.225,95	0,10
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	1.500.000	1.441.992,20	0,45
USD US 4.5%/06-15.02.2036	2.000.000	2.221.875,00	0,69
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	750.000	726.357,42	0,23
USD US TREASURY 1.625%/16-150526	3.000.000	2.808.515,64	0,88
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	1.000.000	876.718,75	0,27
USD US TREASURY N/B 1.875%/19-31.07.2026	1.000.000	940.703,13	0,29
USD US TREASURY N/B 2.125%/17-290224	1.750.000	1.709.804,69	0,53
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	1.500.000	1.411.289,07	0,44
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	3.000.000	2.889.609,39	0,90
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	4.000.000	3.732.187,52	1,17
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	2.000.000	1.630.000,00	0,51
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	3.500.000	3.380.335,00	1,06
<b>Total Anleihen</b>		<b>53.872.505,97</b>	<b>16,85</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>		<b>98.179.029,52</b>	<b>30,70</b>

**Investmentfonds**

Fondsanteile (Open-End)	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	9.474	7.868.725,44	2,46
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	382	1.031.735,76	0,32
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	27.172	6.223.326,10	1,95
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	4.829	6.266.735,91	1,96
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	1.222	2.773.557,60	0,87
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	2.893	6.103.564,61	1,91
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	39.536	5.691.390,05	1,78

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	289.759	44.906.849,82	14,04
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	1.862	286.301,12	0,09
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	179	158.989,02	0,05
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	11.146	9.947.916,46	3,11
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - QBX- USD	18.022	18.653.581,96	5,83
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR	3.212	4.542.513,07	1,42
JPY ACC- EUR	4.770	5.072.099,88	1,59
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	2.619	4.014.081,48	1,26
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP	2.619	4.014.081,48	1,26
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	2.540	3.069.488,40	0,96
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	4.905	4.149.027,08	1,30
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	2.561	3.912.562,03	1,22
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	36.008	40.153.931,12	12,56
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -EB- USD	1.635	3.096.526,50	0,97
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	339	423.379,98	0,13
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	3.288	3.928.305,12	1,23
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	4.176	5.148.298,08	1,61
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	10.203	9.782.840,46	3,06
USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	6.193	641.532,87	0,20
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	76.272	8.057.374,08	2,52
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	53.154	7.796.628,72	2,44
<b>Total Fondsanteile (Open-End)</b>		<b>216.494.376,46</b>	<b>67,71</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>216.494.376,46</b>	<b>67,71</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>314.673.405,98</b>	<b>98,41</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		5.113.157,74	1,60
Andere Passiva		-35.633,41	-0,01
<b>Fondsvermögen</b>		<b>319.750.930,31</b>	<b>100,00</b>

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

**Technische Daten und Erläuterungen****Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B - Thesaurierend	EUR	951292	LU0091101195	1,70%	2,14%
EB - Thesaurierend	EUR	28344652	LU1237499287	0,60%	1,02%
IA - Ausschüttend	EUR	29019344	LU1267071774	0,60%	1,04%
IB - Thesaurierend	EUR	1057479	LU0108837765	0,60%	1,03%
UB - Thesaurierend	EUR	26362750	LU1144411474	1,40%	1,84%

**Fondsperformance**

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	EUR	4,90%	/	-15,01%	16,69%	2,97%
EB - Thesaurierend	EUR	5,19%	-6,10%	-14,05%	/	/
IA - Ausschüttend	EUR	5,19%	/	-14,07%	17,98%	4,11%
IB - Thesaurierend	EUR	5,19%	/	-14,07%	17,98%	4,11%
UB - Thesaurierend	EUR	4,98%	/	-14,75%	17,04%	3,28%

**Erläuterungen****Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
<i>Gegenpartei</i>					
USD	1.300.000	EUR	-1.213.454	12.05.2023	-19.776,12
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	260.000	EUR	-243.955	12.05.2023	-5.219,04
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	193.725	CAD	-280.000	12.05.2023	3.649,85
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	480.000	EUR	-451.134	12.05.2023	-10.391,57
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	116.000.000	EUR	-826.855	12.05.2023	-21.671,67
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.070.000	EUR	-991.404	12.05.2023	-8.915,68
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CAD	280.000	EUR	-191.654	12.05.2023	-1.572,07
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	15.897.941	USD	-17.130.000	12.05.2023	169.346,84
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften</b>					<b>105.450,54</b>

## Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR

**Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		116.752.602,52			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.720.999,03			
Forderungen aus Erträgen		66.832,12			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		105.450,54			
		<b>118.645.884,21</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		170.453,10			
		<b>170.453,10</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>118.475.431,11</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>EUR</b>	<b>118.475.431,11</b>	<b>153.417.346,72</b>	<b>120.346.558,05</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
B - Thesaurierend	EUR	199,88	212,91	204,05	
EB - Thesaurierend	EUR	939,02	989,13	/	
IA - Ausschüttend	EUR	1.293,94	1.363,23	1.292,26	
IB - Thesaurierend	EUR	1.594,61	1.680,00	1.592,48	
UB - Thesaurierend	EUR	126,60	134,45	128,47	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
B - Thesaurierend	EUR	392.347,416	467.553,072	21.707,092	96.912,748
EB - Thesaurierend	EUR	4.660,040	4.658,040	2,000	0,000
IA - Ausschüttend	EUR	9.866,049	9.998,710	24,339	157,000
IB - Thesaurierend	EUR	1.172,480	7.539,186	36,874	6.403,580
UB - Thesaurierend	EUR	166.216,295	170.820,952	21.345,255	25.949,912

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>153.417.346,72</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	188.534,75
Dividenden (Netto)	606.665,14
Bankzinsen	37.564,07
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.347,84
Andere Erträge	20.582,81
	<b>855.694,61</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	1.911.681,22
Depotbank- und Depotgebühr	82.990,07
Zentralverwaltungsvergütung	79.814,68
Druck- und Veröffentlichungskosten	13.182,95
Zinsen und Bankspesen	2.220,38
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	49.013,38
"Taxe d'abonnement"	27.016,45
	<b>2.165.919,13</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-1.310.224,52</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	3.374.133,24
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.975.562,57
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	47.686,78
	<b>1.446.257,45</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>136.032,93</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-10.126.378,08
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	726.857,15
	<b>-9.399.520,93</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-9.263.488,00</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	7.156.095,91
Rücknahmen	-32.834.523,52
	<b>-25.678.427,61</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>118.475.431,11</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Luxemburg	52,45
Irland	20,57
Vereinigte Staaten	9,62
Frankreich	5,96
Niederlande	2,35
Deutschland	2,01
Schweiz	1,45
Spanien	1,09
Italien	0,83
Finnland	0,64
Supranational	0,46
Australien	0,23
Kanada	0,16
Portugal	0,16
Mexiko	0,15
Norwegen	0,15
Niederländische Antillen	0,11
Polen	0,08
Belgien	0,07
<b>Total</b>	<b>98,55</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	72,01
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,80
Banken und andere Kreditinstitute	2,53
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	2,09
Länder und Zentralregierungen	2,05
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	1,54
Versicherungsgesellschaften	1,51
Elektronik und Halbleiter	1,44
Energie- und Wasserversorgung	1,40
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,13
Petroleum	1,04
Elektrische Geräte und Komponenten	0,94
Chemie	0,83
Fahrzeuge	0,73
Einzelhandel und Warenhäuser	0,71
Baustoffe und Bauindustrie	0,65
Computerhardware und Netzwerk	0,62
Telekommunikation	0,59
Grafikverlags- und Druckmedien	0,59
Supranationale Organisationen	0,46
Verkehr und Transport	0,43
Fotografie und Optik	0,38
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,36
Immobilien	0,31
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,31
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,23
Verschiedene Konsumgüter	0,21
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,16
Gesundheits- und Sozialdienste	0,12
Biotechnologie	0,10
Uhrenindustrie, Schmuck	0,09
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,09
Edelmetalle und Edelsteine	0,05
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,05
<b>Total</b>	<b>98,55</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	3.426	108.285,76	0,09
USD ADOBE	334	118.471,70	0,10
EUR AIR LIQUIDE	5.090	784.878,00	0,66
CHF ALCON INC	544	35.462,77	0,03
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	3.470	738.416,00	0,62
USD ALPHABET A	3.500	334.166,32	0,28
USD ALPHABET C	3.240	310.147,73	0,26
USD AMERICAN EXPRESS	2.080	315.795,48	0,27
USD AMERICAN TOWER	609	114.540,99	0,10
USD AMGEN	541	120.379,91	0,10
EUR ASML HOLDING	2.140	1.337.928,00	1,13
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	296	60.654,87	0,05
EUR AXA	17.300	487.254,50	0,41
CHF BACHEM HOLDING LTD	32	2.946,90	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	7	13.675,57	0,01
CHF BKW	25	3.622,17	0,00
EUR BMW	2.430	245.284,20	0,21
EUR BNP PARIBAS A	9.590	529.463,90	0,45
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	2.160	137.797,05	0,12
USD CATERPILLAR	1.730	364.381,55	0,31
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	686	100.843,73	0,09
USD CISCO SYSTEMS	2.710	130.392,79	0,11
USD COCA-COLA	3.730	212.961,39	0,18
EUR CRH PLC	8.800	408.980,00	0,35
EUR DANONE	6.100	349.591,00	0,30
USD ECOLAB	455	69.323,16	0,06
USD ELEVANCE HEALTH	243	102.843,05	0,09
USD ELI LILLY & CO	817	258.248,55	0,22
EUR ENEL	46.400	261.092,80	0,22
EUR ESSILORLUXOTTICA	2.710	449.860,00	0,38
CHF GEBERIT	78	40.017,73	0,03
CHF GIVAUDAN REG	21	62.904,79	0,05
USD HOME DEPOT	908	242.646,38	0,21
EUR IBERDROLA	35.757	410.669,15	0,35
USD IBM	591	71.309,19	0,06
EUR INDITEX	8.010	247.509,00	0,21
EUR ING GROUP	32.200	351.946,00	0,30
USD INTEL	2.690	80.889,41	0,07
USD INTUIT	175	71.812,09	0,06
USD JOHNSON & JOHNSON	2.420	345.252,89	0,29
EUR KERING	600	360.000,00	0,30
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	10.881,61	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	302	16.157,38	0,01
CHF LONZA REG	98	54.060,58	0,05
EUR L'OREAL	2.300	945.875,00	0,80
USD LOWE'S COMPANIES	551	101.416,05	0,09
EUR LVMH	2.040	1.722.576,00	1,45
USD MASTERCARD	564	188.654,09	0,16
USD MERCK & CO	2.560	250.686,55	0,21
USD MICROSOFT	5.050	1.340.066,27	1,13
USD MORGAN STANLEY	4.190	338.609,23	0,29
EUR NESTE OYJ	11.900	540.617,00	0,46
CHF NESTLE REG	3.400	381.827,71	0,32
USD NEWMONT MINING	1.290	58.204,06	0,05
USD NIKE B	917	103.512,25	0,09
CHF NOVARTIS REG	2.600	219.421,66	0,19
USD NUCOR	387	55.023,14	0,05
USD NVIDIA	1.780	455.088,22	0,38
EUR ORANGE	31.900	349.368,80	0,29
CHF PARTNERS GROUP	30	25.898,24	0,02
USD PEPSICO	1.150	192.963,32	0,16
USD PROCTER & GAMBLE	1.810	247.714,02	0,21
USD PROLOGIS	1.210	138.958,72	0,12
EUR REPSOL	32.400	459.594,00	0,39
CHF ROCHE HOLDING	29	8.035,26	0,01
CHF ROCHE HOLDING CERT	900	236.629,72	0,20
USD S&P GLOBAL	1.110	352.243,27	0,30
USD SALESFORCE.COM	654	120.259,67	0,10
EUR SAP SE	5.460	633.687,60	0,53
USD SCHLUMBERGER	2.980	134.675,32	0,11
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	6.070	932.837,60	0,79
USD SEMPRA ENERGY	722	100.453,33	0,08
USD SHERWIN-WILLIAMS	364	75.306,07	0,06
CHF SIKA LTD	278	71.565,74	0,06
CHF SONOVA HOLDING REG	64	17.320,30	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	121	16.623,02	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	94	7.202,72	0,01
CHF SWISS REINSURANCE	496	46.896,36	0,04
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	32	18.803,43	0,02
USD TARGET	408	62.199,86	0,05
USD TESLA MOTORS	2.150	410.547,20	0,35
USD TEXAS INSTRUMENTS	662	111.628,26	0,09
CHF THE SWATCH GROUP	28	8.841,51	0,01
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	324	171.884,47	0,15
USD TJX COS	936	67.508,82	0,06
CHF UBS GROUP	5.053	98.208,94	0,08
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	2.190	108.153,15	0,09
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	2.390	426.744,07	0,36
USD VALERO ENERGY	755	97.011,37	0,08
USD VERIZON COMMUNICATIONS	3.000	107.386,44	0,09
USD VISA A	972	201.709,35	0,17
USD WALT DISNEY	1.180	108.751,81	0,09
EUR WOLTERS KLUWER	2.960	344.396,00	0,29

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

**Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)**

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	248	109.369,87	0,09
<b>Total Aktien</b>		<b>24.200.701,20</b>	<b>20,43</b>
<b>Anleihen</b>			
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	250.000	227.457,50	0,19
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	500.000	445.211,47	0,38
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	500.000	404.685,00	0,34
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	250.000	216.199,55	0,18
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	200.000	178.956,00	0,15
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	100.000	85.991,00	0,07
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	81.000	53.209,84	0,04
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-150229	100.000	89.118,00	0,08
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	250.000	179.789,68	0,15
EUR DAIMLER AG 0.75%/20-10.09.2030	250.000	208.175,00	0,18
EUR E.ON SE 0.875%/20-200831	200.000	160.640,00	0,14
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	100.000	96.260,00	0,08
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-280728	100.000	99.465,00	0,08
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	250.000	224.580,05	0,19
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	100.000	80.715,00	0,07
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	250.000	222.315,00	0,19
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	50.000	41.728,50	0,04
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	250.000	226.464,63	0,19
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	100.000	85.220,00	0,07
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	250.000	218.675,50	0,18
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	750.000	681.270,00	0,58
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	250.000	205.221,13	0,17
EUR KFW 2.75%/23-140233	100.000	99.323,00	0,08
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	200.000	177.073,96	0,15
EUR NATURGY FINANCE 0.875%/17-150525	300.000	283.809,00	0,24
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	150.000	140.436,00	0,12
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	100.000	95.424,00	0,08
EUR OBRIGACIOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	100.000	96.954,00	0,08
EUR PROLOGIS INTL FUND I 0.875%/19-09.07.2029	125.000	98.206,25	0,08
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	200.000	134.943,38	0,11
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	100.000	91.995,00	0,08
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	250.000	202.186,02	0,17
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	342.000	225.892,45	0,19
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	89.000	51.256,47	0,04
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	300.000	259.798,25	0,22
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	250.000	221.640,00	0,19
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	250.000	214.700,83	0,18
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	250.000	187.537,39	0,16
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	250.000	222.239,86	0,19
<b>Total Anleihen</b>		<b>7.234.763,71</b>	<b>6,11</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>		<b>31.435.464,91</b>	<b>26,53</b>

<b>Investmentfonds</b>			
<b>Fondsanteile (Open-End)</b>			
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	3.791	2.898.111,24	2,45
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	355	881.764,58	0,74
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	37.691	7.945.639,71	6,71
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	958	1.144.838,44	0,97
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	567	1.183.911,71	1,00
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	1.239	2.406.005,83	2,03
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	49.862	6.606.715,00	5,58
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	116.268	16.585.406,27	14,00
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	10.077	1.426.148,94	1,20
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -OBX USD- USD	65	53.514,92	0,05
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -OBX USD- USD	2.952	2.425.044,43	2,05
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -OBX- USD	10.938	10.420.422,04	8,80
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -OBX EUR ACC- EUR	3.426	4.459.624,20	3,76
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -OBX- JPY	3.650	3.572.337,96	3,02
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -OBX GBP ACC- GBP	1.784	2.516.725,16	2,12

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -OBX USD ACC- USD	1.808	2.011.041,17	1,70
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -OBX CAD ACC- CAD	2.686	2.091.238,29	1,77
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	1.000	1.406.406,19	1,19
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	1.461	1.499.567,33	1,27
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -EB- USD	991	1.727.511,53	1,46
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	92	62.683,12	0,05
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	1.039	1.222.088,55	1,03
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	225	258.644,58	0,22
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	658	723.585,00	0,61
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	691	784.100,08	0,66
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	3.981	3.513.334,64	2,97
USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	2.371	226.068,29	0,19
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	29.772	2.894.853,96	2,44
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	17.553	2.369.804,45	2,00
<b>Total Fondsanteile (Open-End)</b>		<b>85.317.137,61</b>	<b>72,01</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>85.317.137,61</b>	<b>72,01</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>116.752.602,52</b>	<b>98,55</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		1.720.999,03	1,45
Andere Nettvermögenswerte		1.829,56	0,00
<b>Fondsvermögen</b>		<b>118.475.431,11</b>	<b>100,00</b>

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%	2,11%
IB - Thesaurierend	CHF	1057460	LU0108837336	0,60%	1,01%
UB - Thesaurierend	CHF	26362874	LU1144411557	1,40%	1,81%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	CHF	3,81%	/	-18,16%	12,70%	3,31%
IB - Thesaurierend	CHF	4,10%	/	-17,25%	13,94%	4,45%
UB - Thesaurierend	CHF	3,89%	/	-17,91%	13,03%	3,62%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In CHF)
<i>Gegenpartei</i>					
CHF	31.275.068	USD	-34.070.000	12.05.2023	292.986,92
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	1.697.538	CAD	-2.480.000	12.05.2023	30.230,39
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	860.000	CHF	-784.901	12.05.2023	-2.813,62
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	2.944.488	EUR	-3.000.000	12.05.2023	-26.786,51
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	148.000.000	CHF	-1.043.529	12.05.2023	-26.082,66
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	55.000.000	CHF	-383.481	12.05.2023	-5.376,41
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	2.820.027	EUR	-2.850.000	12.05.2023	-2.636,11
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften</b>					<b>259.522,00</b>

**Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		256.370.068,65			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.765.428,11			
Forderungen aus Erträgen		121.317,05			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		259.522,00			
Andere Aktiva		5.564,59			
		<b>260.521.900,40</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		395.304,41			
		<b>395.304,41</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>260.126.595,99</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>					
		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>CHF</b>	<b>260.126.595,99</b>	<b>305.250.667,91</b>	<b>276.315.920,81</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
B - Thesaurierend	CHF	218,48	243,71	242,19	
IB - Thesaurierend	CHF	1.234,88	1.362,43	1.339,13	
UB - Thesaurierend	CHF	124,07	137,98	136,71	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>					
		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
B - Thesaurierend	CHF	793.093,538	827.798,808	88.114,191	122.819,461
IB - Thesaurierend	CHF	5.586,336	7.813,067	0,000	2.226,731
UB - Thesaurierend	CHF	644.413,361	672.993,437	75.275,167	103.855,243

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>305.250.667,91</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	248.644,54
Dividenden (Netto)	1.628.133,26
Bankzinsen	64.815,14
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	4.172,01
Andere Erträge	39.422,01
	<b>1.985.186,96</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	4.309.573,80
Depotbank- und Depotgebühr	171.534,00
Zentralverwaltungsvergütung	164.678,87
Druck- und Veröffentlichungskosten	19.345,28
Zinsen und Bankspesen	5.365,34
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	64.357,81
"Taxe d'abonnement"	67.919,02
	<b>4.802.774,12</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-2.817.587,16</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	1.721.761,89
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.185.774,20
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	356.199,67
	<b>892.187,36</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-1.925.399,80</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-29.671.921,72
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	54.840,57
	<b>-29.617.081,15</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-31.542.480,95</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	29.086.965,48
Rücknahmen	-42.668.556,45
	<b>-13.581.590,97</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>260.126.595,99</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Luxemburg	49,42
Schweiz	21,58
Irland	13,59
Vereinigte Staaten	9,50
Deutschland	0,76
Supranational	0,51
Österreich	0,39
Frankreich	0,37
Südkorea	0,36
Niederlande	0,35
Kanada	0,27
Australien	0,23
Spanien	0,20
Chile	0,17
Italien	0,17
Vereinigte Arabische Emirate	0,17
Belgien	0,12
Niederländische Antillen	0,12
Finnland	0,11
Polen	0,09
Mexiko	0,07
<b>Total</b>	<b>98,56</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	62,88
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	7,73
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	5,63
Banken und andere Kreditinstitute	4,01
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,40
Versicherungsgesellschaften	2,10
Elektrische Geräte und Komponenten	1,67
Chemie	1,67
Uhrenindustrie, Schmuck	1,37
Länder und Zentralregionen	1,25
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,94
Baustoffe und Bauindustrie	0,81
Gesundheits- und Sozialdienste	0,54
Telekommunikation	0,53
Computerhardware und Netzwerk	0,53
Supranationale Organisationen	0,51
Verkehr und Transport	0,45
Elektronik und Halbleiter	0,39
Fahrzeuge	0,38
Grafikverlags- und Druckmedien	0,33
Immobilien	0,32
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,32
Petroleum	0,26
Energie- und Wasserversorgung	0,25
Einzelhandel und Warenhäuser	0,24
Verschiedene Konsumgüter	0,22
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,19
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,18
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,14
Biotechnologie	0,11
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,10
Edelmetalle und Edelsteine	0,05
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,05
Fotografie und Optik	0,02
<b>Total</b>	<b>98,56</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	112.000	3.513.440,00	1,35
USD ADOBE	774	272.483,14	0,10
EUR AIR LIQUIDE	702	107.436,54	0,04
CHF ALCON INC	17.900	1.158.130,00	0,45
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	478	100.955,51	0,04
USD ALPHABET A	8.110	768.503,77	0,30
USD ALPHABET C	7.510	713.500,12	0,27
USD AMERICAN EXPRESS	4.810	724.799,97	0,28
USD AMERICAN TOWER	1.410	263.204,48	0,10
USD AMGEN	1.250	276.056,05	0,11
EUR ASML HOLDING	295	183.050,75	0,07
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	687	133.720,84	0,05
EUR AXA	2.390	66.809,49	0,03
CHF BACHEM HOLDING LTD	1.070	97.798,00	0,04
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	144	279.216,33	0,11
CHF BKW	850	123.230,00	0,05
EUR BMW	335	33.561,29	0,01
EUR BNP PARIBAS A	1.320	73.330,62	0,03
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	5.000	316.582,33	0,12
USD CATERPILLAR	4.000	836.204,89	0,32
CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI	4	432.000,00	0,17
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	22.500	3.282.750,00	1,26
USD CISCO SYSTEMS	6.270	299.421,07	0,12
USD COCA-COLA	8.650	490.160,89	0,19
EUR CRH PLC	1.210	55.812,99	0,02
EUR DANONE	841	47.836,23	0,02
USD ECOLAB	1.050	158.776,71	0,06
USD ELEVANCE HEALTH	562	236.067,12	0,09
USD ELI LILLY & CO	1.890	592.936,46	0,23
EUR ENEL	6.400	35.742,70	0,01
EUR ESSILORLUXOTTICA	373	61.453,62	0,02
CHF GEBERIT	2.570	1.308.644,00	0,50
CHF GVAUDAN REG	694	2.063.262,00	0,79
USD HOME DEPOT	2.100	566.159,38	0,22
EUR IBERDROLA	4.862	55.421,27	0,02
USD IBM	1.370	164.063,10	0,06
EUR INDITEX	1.100	33.735,08	0,01
EUR ING GROUP	4.440	48.165,23	0,02
USD INTEL	6.220	185.635,18	0,07
USD INTUIT	406	165.354,53	0,06
USD JOHNSON & JOHNSON	5.600	792.940,31	0,30
EUR KERING	83	49.426,50	0,02
CHF LINDT & SPRUENGLI	38	410.400,00	0,16
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	9.950	528.345,00	0,20
CHF LONZA REG	3.190	1.746.206,00	0,67
EUR L'OREAL	317	129.388,50	0,05
USD LOWE'S COMPANIES	1.280	233.827,50	0,09
EUR LVMH	281	235.496,83	0,09
USD MASTERCARD	1.310	434.899,53	0,17
USD MERCK & CO	5.930	576.336,70	0,22
USD MICROSOFT	11.700	3.081.422,68	1,18
USD MORGAN STANLEY	9.720	779.617,45	0,30
EUR NESTE OYJ	1.640	73.946,41	0,03
CHF NESTLE REG	111.000	12.372.060,00	4,76
USD NEWMONT MINING	2.990	133.895,28	0,05
USD NIKE B	2.120	237.513,76	0,09
CHF NOVARTIS REG	85.000	7.119.600,00	2,74
USD NUCOR	896	126.436,63	0,05
USD NVIDIA	4.120	1.045.450,14	0,40
EUR ORANGE	4.400	47.827,38	0,02
CHF PARTNERS GROUP	1.020	873.936,00	0,34
USD PEPSICO	2.660	442.985,06	0,17
USD PROCTER & GAMBLE	4.190	569.136,65	0,22
USD PROLOGIS	2.800	319.145,69	0,12
EUR REPSOL	4.470	62.931,40	0,02
CHF ROCHE HOLDING	953	262.075,00	0,10
CHF ROCHE HOLDING CERT	29.500	7.698.025,00	2,96
USD S&P GLOBAL	2.570	809.437,58	0,31
USD SALESFORCE.COM	1.520	277.406,33	0,11
EUR SAP SE	752	86.622,54	0,03
USD SCHLUMBERGER	6.900	309.493,37	0,12
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	836	127.512,91	0,05
USD SEMPRA ENERGY	1.670	230.607,87	0,09
USD SHERWIN-WILLIAMS	843	173.095,86	0,07
CHF SIKA LTD	9.140	2.335.270,00	0,90
CHF SONOVA HOLDING REG	2.110	566.746,00	0,22
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	3.990	544.036,50	0,21
CHF SWISS PRIME SITE	3.090	234.994,50	0,09
CHF SWISS REINSURANCE	16.300	1.529.592,00	0,59
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	1.040	606.528,00	0,23
USD TARGET	946	143.136,67	0,06
USD TESLA MOTORS	4.980	943.809,81	0,36
USD TEXAS INSTRUMENTS	1.510	256.586,62	0,10
CHF THE SWATCH GROUP	907	284.253,80	0,11
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	751	395.423,14	0,15
USD TJX COS	2.170	155.337,01	0,06
CHF UBS GROUP	166.000	3.202.140,00	1,23
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	302	14.802,41	0,01
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	5.540	981.770,28	0,38
USD VALERO ENERGY	1.750	223.174,33	0,09
USD VERIZON COMMUNICATIONS	6.950	246.912,75	0,09
USD VISA A	2.250	463.417,89	0,18
USD WALT DISNEY	2.740	250.631,44	0,10

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 Nettovermögens
EUR WOLTERS KLUWER	409	47.230,25	0,02
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	8.120	3.554.124,00	1,37
<b>Total Aktien</b>		<b>79.706.776,61</b>	<b>30,64</b>
<b>Anleihen</b>			
CHF AFRICA FINANCE CORP 1.205%/20-30.09.2025	500.000	475.000,00	0,18
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	250.000	220.936,19	0,08
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	250.000	221.628,19	0,09
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	250.000	200.824,93	0,08
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	250.000	214.578,05	0,08
CHF BANCO DE CREDITO E 0.5994%/22-260427	500.000	451.000,00	0,17
CHF BAWAG P.S.K. 2.955%/22-291127	1.000.000	1.006.500,00	0,39
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	100.000	85.346,07	0,03
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	250.000	230.160,75	0,09
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	50.000	41.753,48	0,02
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	50.000	45.924,96	0,02
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	86.000	56.070,69	0,02
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	250.000	178.441,26	0,07
EUR COOPERATIVE RABOBANK UA S. -3221A-0.25%/19-30.10.2026	200.000	178.159,71	0,07
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	250.000	200.274,09	0,08
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	250.000	220.647,64	0,08
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	500.000	451.000,00	0,17
CHF HYUNDAI CAPIT SRV INC 3.0325%/23-010228	920.000	928.740,00	0,36
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	250.000	224.766,15	0,09
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	250.000	227.878,00	0,09
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	250.000	211.452,13	0,08
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	200.000	173.628,35	0,07
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	250.000	203.681,97	0,08
EUR KFW 2.75%/23-140233	250.000	246.445,19	0,09
CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028	1.500.000	1.312.500,00	0,50
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	250.000	227.648,32	0,09
CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028	500.000	450.500,00	0,17
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	400.000	311.903,05	0,12
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	642.000	429.919,49	0,17
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	250.000	228.262,59	0,09
USD ROYAL BANK OF CANADA S H 1.15%/21-140726	250.000	205.059,11	0,08
EUR TELEFONICA EMISIONES SAU 1.069%/19-05.02.2024	300.000	292.018,31	0,11
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	400.000	262.220,19	0,10
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	178.000	101.744,10	0,04
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	500.000	439.098,98	0,17
USD US 4.5%/06-15.02.2036	250.000	253.717,49	0,10
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	250.000	221.182,06	0,09
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	300.000	257.849,76	0,10
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	500.000	439.955,41	0,17
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	500.000	426.181,15	0,16
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	500.000	372.261,72	0,14
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	200.000	176.458,45	0,07
<b>Total Anleihen</b>		<b>13.103.317,98</b>	<b>5,04</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>		<b>92.810.094,59</b>	<b>35,68</b>

**Investmentfonds**

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermögens
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	8.273	6.277.038,71	2,41
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	661	1.628.433,44	0,63
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	29.363	6.143.588,92	2,36
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	2.164	2.565.082,66	0,99
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	1.391	2.883.478,02	1,11
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	2.610	5.030.329,01	1,93
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	21.680	2.851.055,50	1,10
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	172.669	24.446.168,54	9,40
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	10.612	1.490.600,91	0,57
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -OBX USD- USD	128	104.345,30	0,04
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -OBX USD- USD	6.477	5.280.932,00	2,03
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -OBX- USD	24.518	23.182.773,40	8,91
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -OBX EUR ACC- EUR	3.777	4.879.646,99	1,88

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermögens
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -OBX- JPY	7.239	7.031.836,52	2,70
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -OBX GBP ACC- GBP	3.696	5.174.917,36	1,99
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -OBX USD ACC- USD	3.511	3.876.001,00	1,49
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -OBX CAD ACC- CAD	6.790	5.246.839,79	2,02
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	2.160	3.015.053,58	1,16
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	7.473	7.612.744,48	2,93
CHF CS INVESTMENT FUNDS 14 - CREDIT SUISSE (LUX) SWISS FRANC BOND FUND -EB-	82.586	9.445.360,82	3,63
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -EB- USD	1.693	2.929.103,87	1,13
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	187	126.454,69	0,05
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	2.307	2.693.179,10	1,04
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	7.401	8.443.874,91	3,25
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	1.357	1.481.064,67	0,57
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	1.913	2.154.462,48	0,83
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	8.830	7.734.256,29	2,97
USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	4.898	463.508,16	0,18
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	61.898	5.973.457,53	2,30
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	25.332	3.394.385,41	1,30
<b>Total Fondsantheile (Open-End)</b>		<b>163.559.974,06</b>	<b>62,88</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>163.559.974,06</b>	<b>62,88</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>256.370.068,65</b>	<b>98,56</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.765.428,11	1,45
Andere Passiva		-8.900,77	-0,01
<b>Fondsvermögen</b>		<b>260.126.595,99</b>	<b>100,00</b>

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%	2,16%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
B - Thesaurierend	USD	5,43%	/	-19,18%	12,68%	11,57%
EB - Thesaurierend	USD	5,73%	/	-18,27%	13,95%	12,83%
UB - Thesaurierend	USD	5,52%	/	-18,94%	13,01%	11,91%
IB - Thesaurierend	USD	5,72%	-10,30%	-18,29%	/	/
BH - Thesaurierend	JPY	4,15%	/	-21,28%	12,14%	10,16%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
JPY	777.893.700	USD	-587.595	13.04.2023	-1.242,43
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	150.284.400	USD	-1.139.870	13.04.2023	-8.588,04
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
JPY	1.705.281.400	USD	-12.632.575	13.04.2023	204.108,52
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	49.528.500	USD	-377.474	13.04.2023	-4.643,51
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	1.855.565.800	USD	-14.100.556	26.04.2023	-106.321,13
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
JPY	151.000.000	USD	-1.159.598	12.05.2023	-18.114,91
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	500.000	USD	-532.164	12.05.2023	12.371,50
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	370.000	USD	-398.801	12.05.2023	4.154,80
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
EUR	320.000	USD	-345.360	12.05.2023	3.143,04
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.668.189	EUR	-2.480.000	12.05.2023	-32.628,77
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften</b>					<b>52.239,07</b>

**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		175.074.788,99			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.624.517,36			
Forderungen aus Erträgen		131.363,58			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		52.239,07			
		<b>178.882.909,00</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		281.302,36			
Andere Passiva		27,73			
		<b>281.330,09</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>178.601.578,91</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>					
		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>USD</b>	<b>178.601.578,91</b>	<b>216.699.854,49</b>	<b>118.103.374,30</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
B - Thesaurierend	USD	309,88	343,81	332,58	
EB - Thesaurierend	USD	1.427,56	1.566,17	1.498,08	
UB - Thesaurierend	USD	138,89	153,63	148,17	
IB - Thesaurierend	USD	897,00	984,31	/	
BH - Thesaurierend	JPY	10.683,00	12.306,00	11.953,00	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>					
		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
B - Thesaurierend	USD	395.396.879	426.082.865	18.495.231	49.181.217
EB - Thesaurierend	USD	6.662.648	6.371.444	1.450.623	1.159.419
UB - Thesaurierend	USD	103.091.712	107.777.161	12.431.577	17.117.026
IB - Thesaurierend	USD	3.000.000	3.000.000	0,000	0,000
BH - Thesaurierend	JPY	364.223.717	401.635.746	29.497.021	66.909.050

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>216.699.854,49</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	436.715,20
Dividenden (Netto)	710.057,87
Bankzinsen	71.529,78
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	1.239,84
Andere Erträge	21.270,78
	<b>1.240.813,47</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	2.994.189,03
Depotbank- und Depotgebühr	116.573,13
Zentralverwaltungsvergütung	111.914,42
Druck- und Veröffentlichungskosten	16.414,62
Zinsen und Bankspesen	252,10
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	94.782,88
"Taxe d'abonnement"	48.167,15
	<b>3.382.293,33</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-2.141.479,86</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.425.240,08
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-6.047.864,14
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-622.068,22
	<b>-10.095.172,44</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-12.236.652,30</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-16.104.025,84
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	2.004.994,90
	<b>-14.099.030,94</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-26.335.683,24</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	11.986.111,66
Rücknahmen	-23.748.704,00
	<b>-11.762.592,34</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>178.601.578,91</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Luxemburg	41,09
Vereinigte Staaten	29,51
Irland	21,17
Schweiz	1,31
Niederlande	0,81
Supranational	0,81
Frankreich	0,72
Deutschland	0,54
Australien	0,49
Norwegen	0,40
Niederländische Antillen	0,34
Mexiko	0,22
Finnland	0,16
Kanada	0,16
Italien	0,13
Spanien	0,11
Belgien	0,03
Polen	0,02
<b>Total</b>	<b>98,03</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	62,08
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	6,90
Banken und andere Kreditinstitute	4,54
Länder und Zentralregierungen	4,27
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	3,03
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,60
Energie- und Wasserversorgung	1,12
Verkehr und Transport	1,09
Fahrzeuge	1,07
Elektronik und Halbleiter	1,06
Computerhardware und Netzwerk	0,98
Grafikverlags- und Druckmedien	0,93
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,93
Baustoffe und Bauindustrie	0,89
Supranationale Organisationen	0,81
Telekommunikation	0,73
Petroleum	0,69
Immobilien	0,66
Einzelhandel und Warenhäuser	0,65
Verschiedene Konsumgüter	0,63
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,44
Chemie	0,35
Elektrische Geräte und Komponenten	0,34
Biotechnologie	0,31
Versicherungsgesellschaften	0,29
Gesundheits- und Sozialdienste	0,29
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,28
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,27
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,21
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,16
Edelmetalle und Edelsteine	0,15
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,14
Uhrenindustrie, Schmuck	0,08
Fotografie und Optik	0,04
<b>Total</b>	<b>98,03</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	4.321	148.380,90	0,08
USD ADOBE	1.400	539.518,00	0,30
EUR AIR LIQUIDE	836	140.055,57	0,08
CHF ALCON INC	687	48.656,43	0,03
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	570	131.782,04	0,07
USD ALPHABET A	14.700	1.524.831,00	0,85
USD ALPHABET C	13.600	1.414.400,00	0,79
USD AMERICAN EXPRESS	8.700	1.435.065,00	0,80
USD AMERICAN TOWER	2.550	521.067,00	0,29
USD AMGEN	2.270	548.772,50	0,31
EUR ASML HOLDING	351	238.416,24	0,13
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	1.240	276.061,20	0,15
EUR AXA	2.850	87.209,61	0,05
CHF BACHEM HOLDING LTD	41	4.102,13	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	5	10.612,73	0,01
CHF BKW	33	5.194,60	0,00
EUR BMW	399	43.756,84	0,02
EUR BNP PARIBAS A	1.580	94.772,99	0,05
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	9.050	627.255,50	0,35
USD CATERPILLAR	7.240	1.656.801,60	0,93
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	865	138.149,92	0,08
USD CISCO SYSTEMS	11.400	595.935,00	0,33
USD COCA-COLA	15.700	973.871,00	0,55
EUR CRH PLC	1.450	73.214,51	0,04
EUR DANONE	1.000	62.264,45	0,03
USD ECOLAB	1.910	316.162,30	0,18
USD ELEVANCE HEALTH	1.020	469.006,20	0,26
USD ELI LILLY & CO	3.420	1.174.496,40	0,66
EUR ENEL	7.630	46.645,66	0,03
EUR ESSILORLUXOTTICA	445	80.256,06	0,04
CHF GEBERIT	98	54.625,28	0,03
CHF GVAUDAN REG	26	84.615,02	0,05
USD HOME DEPOT	3.810	1.124.407,20	0,63
EUR IBERDROLA	5.821	72.633,73	0,04
USD IBM	2.480	325.103,20	0,18
EUR INDITEX	1.320	44.314,12	0,02
EUR ING GROUP	5.290	62.818,21	0,04
USD INTEL	11.300	369.171,00	0,21
USD INTUIT	735	327.685,05	0,18
USD JOHNSON & JOHNSON	10.100	1.565.500,00	0,88
EUR KERING	99	64.535,13	0,04
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	11.822,33	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	382	22.204,30	0,01
EUR LONZA REG	125	74.902,11	0,04
EUR L'OREAL	378	168.891,37	0,09
USD LOWE'S COMPANIES	2.310	461.930,70	0,26
EUR LVMH	335	307.328,46	0,17
USD MASTERCARD	2.370	861.281,70	0,48
USD MERCK & CO	10.700	1.138.373,00	0,64
USD MICROSOFT	21.200	6.111.960,00	3,42
USD MORGAN STANLEY	17.600	1.545.280,00	0,87
EUR NESTE OYJ	1.950	96.246,98	0,05
CHF NESTLE REG	4.279	522.084,20	0,29
USD NEWMONT MINING	5.410	265.198,20	0,15
USD NIKE B	3.850	472.164,00	0,26
CHF NOVARTIS REG	3.279	300.647,30	0,17
USD NUCOR	1.620	250.241,40	0,14
USD NVIDIA	7.450	2.069.386,50	1,16
EUR ORANGE	5.250	62.468,70	0,03
CHF PARTNERS GROUP	39	36.578,28	0,02
USD PEPSICO	4.820	878.686,00	0,49
USD PROCTER & GAMBLE	7.580	1.127.070,20	0,63
CHF PROLOGIS	5.060	631.336,20	0,35
EUR REPSOL	5.330	82.142,19	0,05
CHF ROCHE HOLDING	36	10.837,13	0,01
CHF ROCHE HOLDING CERT	1.136	324.500,12	0,18
USD S&P GLOBAL	4.650	1.603.180,50	0,90
USD SALESFORCE.COM	2.740	547.397,20	0,31
EUR SAP SE	897	113.105,77	0,06
USD SCHLUMBERGER	12.500	613.750,00	0,34
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	997	166.464,74	0,09
USD SEMPRA ENERGY	3.030	458.014,80	0,26
USD SHERWIN-WILLIAMS	1.530	343.898,10	0,19
CHF SIKA LTD	351	98.169,65	0,05
CHF SONOVA HOLDING REG	80	23.522,05	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	152	22.687,05	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	119	9.906,62	0,01
CHF SWISS REINSURANCE	626	64.304,53	0,04
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	40	25.536,23	0,01
USD TARGET	1.710	283.227,30	0,16
USD TESLA MOTORS	9.000	1.867.140,00	1,05
USD TEXAS INSTRUMENTS	2.730	507.807,30	0,28
CHF THE SWATCH GROUP	34	11.664,26	0,01
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	1.360	783.863,20	0,44
USD TJX COS	3.930	307.954,80	0,17
CHF UBS GROUP	6.377	134.656,67	0,08
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	360	19.315,56	0,01
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	10.000	1.939.900,00	1,09
USD VALERO ENERGY	3.160	441.136,00	0,25
USD VERIZON COMMUNICATIONS	12.600	490.014,00	0,27
USD VISA A	4.080	919.876,80	0,52
USD WALT DISNEY	4.960	496.644,80	0,28
EUR WOLTERS KLUWER	487	61.560,92	0,03

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
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	312	149.489,39	0,08
<b>Total Aktien</b>		<b>47.859.870,93</b>	<b>26,80</b>
<b>Anleihen</b>			
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	500.000	483.700,00	0,27
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	500.000	485.215,00	0,27
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	100.000	87.934,00	0,05
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	1.500.000	1.409.340,00	0,79
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	60.000	56.054,95	0,03
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	57.000	40.680,99	0,02
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	500.000	390.665,00	0,22
EUR COOPERATIVE RABOBANK UA S. -3221A-0.25%/19-30.10.2026	100.000	97.512,15	0,05
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	500.000	476.250,00	0,27
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	500.000	487.990,00	0,27
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	200.000	193.227,31	0,11
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	30.000	27.201,56	0,02
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	1.000.000	984.170,00	0,55
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	100.000	92.587,27	0,05
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	250.000	246.721,93	0,14
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	750.000	668.887,50	0,37
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	750.000	721.432,50	0,40
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	500.000	498.395,00	0,28
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	340.000	249.235,70	0,14
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	35.000	34.981,79	0,02
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	500.000	439.330,00	0,25
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	300.000	215.281,45	0,12
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	267.000	167.062,78	0,09
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	500.000	480.664,07	0,27
USD US 4.5%/06-15.02.2036	1.000.000	1.110.937,50	0,62
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	500.000	484.238,28	0,27
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	1.000.000	876.718,75	0,49
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	1.500.000	1.411.289,07	0,79
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	500.000	481.601,57	0,27
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	1.500.000	1.399.570,32	0,78
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	1.000.000	815.000,00	0,46
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	750.000	724.357,50	0,41
<b>Total Anleihen</b>		<b>16.338.233,94</b>	<b>9,15</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>		<b>64.198.104,87</b>	<b>35,94</b>

**Investmentfonds**

<b>Fondsanteile (Open-End)</b>			
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	5.139	4.268.247,84	2,39
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	356	960.284,01	0,54
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	13.523	3.097.233,87	1,73
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	1.275	1.654.094,35	0,93
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	473	1.073.298,49	0,60
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	1.497	3.158.325,69	1,77
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	13.854	1.994.347,37	1,12
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	150.841	23.377.338,18	13,09
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	25.085	3.857.069,60	2,16
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	48	43.102,77	0,02
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	4.476	3.994.874,76	2,24
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD	15.404	15.943.756,16	8,93
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	4.177	5.907.246,92	3,31
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	3.778	4.017.273,23	2,25
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	2.365	3.624.781,48	2,03
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	2.150	2.598.189,00	1,45
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	4.342	3.672.798,29	2,06

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	857	1.309.206,28	0,73
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	4.574	5.100.604,62	2,86
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -EB- USD	997	1.888.218,30	1,06
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	105	77.725,20	0,04
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	796	1.017.208,40	0,57
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	282	352.192,19	0,20
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	896	1.070.487,04	0,60
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	784	966.538,72	0,54
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	5.511	5.284.057,02	2,96
USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	3.006	311.391,54	0,17
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	39.957	4.221.057,48	2,36
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	41.149	6.035.735,32	3,38
<b>Total Fondsanteile (Open-End)</b>		<b>110.876.684,12</b>	<b>62,08</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>110.876.684,12</b>	<b>62,08</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>175.074.788,99</b>	<b>98,03</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.624.517,36	2,03
Anderere Passiva		-97.727,44	-0,06
<b>Fondsvermögen</b>		<b>178.601.578,91</b>	<b>100,00</b>

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%	1,70%
B - Thesaurierend	EUR	951290	LU0091100890	1,30%	1,70%
CB - Thesaurierend	EUR	52045365	LU2105729961	1,30%	2,40%
EB - Thesaurierend	EUR	28345214	LU1237499444	0,60%	0,98%
IB - Thesaurierend	EUR	1057473	LU0108838904	0,60%	0,99%
UA - Ausschüttend	EUR	26362898	LU1144411714	1,05%	1,45%
UB - Thesaurierend	EUR	26362926	LU1144411805	1,05%	1,45%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	EUR	2,37%	/	-13,61%	6,60%	2,27%
B - Thesaurierend	EUR	2,37%	/	-13,61%	6,60%	2,26%
CB - Thesaurierend	EUR	2,20%	-2,25%	-14,22%	5,86%	/
EB - Thesaurierend	EUR	2,56%	1,62%	-12,99%	7,36%	/
IB - Thesaurierend	EUR	2,55%	/	-13,01%	7,35%	2,98%
UA - Ausschüttend	EUR	2,44%	/	-13,40%	6,87%	2,52%
UB - Thesaurierend	EUR	2,44%	/	-13,40%	6,86%	2,52%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In EUR)
<i>Gegenpartei</i>					
USD	4.230.000	EUR	-3.883.702	12.05.2023	342,34
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	5.400.000	EUR	-5.003.349	12.05.2023	-44.995,05
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.260.000	EUR	-1.164.221	12.05.2023	-7.271,37
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CAD	2.300.000	EUR	-1.565.518	12.05.2023	-4.134,18
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	5.250.000	EUR	-4.900.487	12.05.2023	-79.865,09
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.520.000	EUR	-1.428.592	12.05.2023	-32.906,62
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	1.310.000	EUR	-1.235.311	12.05.2023	-32.450,60
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.000.000	EUR	-935.449	12.05.2023	-17.235,54
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	510.000	EUR	-478.596	12.05.2023	-10.306,49
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	4.000.000	EUR	-3.751.902	12.05.2023	-79.046,63
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	302.000.000	EUR	-2.152.141	12.05.2023	-55.888,78
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	145.912.104	USD	-157.220.000	12.05.2023	1.554.273,81
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	2.981.977	CAD	-4.310.000	12.05.2023	56.181,66
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CAD	700.000	EUR	-473.788	12.05.2023	1.415,84
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften

1.248.113,30

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

**Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		433.159.451,85			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		5.913.548,84			
Forderungen aus Erträgen		1.031.308,50			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		1.248.113,30			
		<b>441.352.422,49</b>			
<b>Passiva</b>					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		727.474,98			
Rückstellungen für Aufwendungen		564.864,81			
Andere Passiva		3.689,07			
		<b>1.296.028,86</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>440.056.393,63</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>EUR</b>	<b>440.056.393,63</b>	<b>604.724.604,92</b>	<b>688.137.614,40</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A - Ausschüttend	EUR	122,51	132,21	132,66	
B - Thesaurierend	EUR	175,09	188,96	189,60	
CB - Thesaurierend	EUR	99,78	108,44	109,57	
EB - Thesaurierend	EUR	1.056,89	1.132,43	1.128,11	
IB - Thesaurierend	EUR	1.227,69	1.315,70	1.310,93	
UA - Ausschüttend	EUR	100,93	108,66	108,75	
UB - Thesaurierend	EUR	105,11	113,15	113,25	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
A - Ausschüttend	EUR	240.222,664	311.335,765	12.357,722	83.470,823
B - Thesaurierend	EUR	1.863.834,777	2.292.272,563	44.142,111	472.579,897
CB - Thesaurierend	EUR	19.875,552	27.605,313	513,680	8.243,441
EB - Thesaurierend	EUR	6.591,113	6.256,369	342,743	7,999
IB - Thesaurierend	EUR	10.836,594	23.600,449	96,874	12.860,729
UA - Ausschüttend	EUR	255.370,544	317.806,570	9.059,466	71.495,492
UB - Thesaurierend	EUR	344.913,661	483.811,313	30.322,366	169.220,018

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>604.724.604,92</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.850.607,20
Dividenden (Netto)	1.165.646,46
Bankzinsen	141.779,53
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	37.382,81
Andere Erträge	99.945,68
	<b>4.295.361,68</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	6.381.548,33
Depotbank- und Depotgebühr	325.339,75
Zentralverwaltungsvergütung	312.586,33
Druck- und Veröffentlichungskosten	36.419,20
Zinsen und Bankspesen	3.771,03
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	133.951,01
"Taxe d'abonnement"	123.851,68
	<b>7.317.467,33</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-3.022.105,65</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	9.635.600,97
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-18.704.549,49
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	556.394,16
	<b>-8.512.554,36</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-11.534.660,01</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-39.989.380,93
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	7.123.603,79
	<b>-32.865.777,14</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-44.400.437,15</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	14.162.863,32
Rücknahmen	-134.430.637,46
	<b>-120.267.774,14</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>440.056.393,63</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Luxemburg	48,39
Irland	9,69
Vereinigte Staaten	8,64
Deutschland	5,92
Niederlande	5,65
Spanien	5,57
Frankreich	4,92
Italien	2,23
Portugal	1,43
Supranational	1,36
Finnland	0,89
Belgien	0,71
Australien	0,65
Norwegen	0,60
Schweiz	0,60
Polen	0,42
Österreich	0,33
Kanada	0,23
Mexiko	0,16
Niederländische Antillen	0,05
<b>Total</b>	<b>98,43</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	56,33
Länder und Zentralregierungen	14,94
Banken und andere Kreditinstitute	9,37
Energie- und Wasserversorgung	2,15
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	2,10
Supranationale Organisationen	1,36
Telekommunikation	1,34
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,23
Versicherungsgesellschaften	1,20
Computerhardware und Netzwerk	0,92
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	0,88
Fahrzeuge	0,80
Verkehr und Transport	0,71
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,61
Elektronik und Halbleiter	0,58
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	0,58
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,44
Petroleum	0,42
Elektrische Geräte und Komponenten	0,38
Chemie	0,33
Einzelhandel und Warenhäuser	0,29
Baustoffe und Bauindustrie	0,27
Grafikverlags- und Druckmedien	0,25
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,23
Fotografie und Optik	0,15
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,14
Immobilien	0,13
Verschiedene Konsumgüter	0,09
Biotechnologie	0,05
Gesundheits- und Sozialdienste	0,05
Uhrenindustrie, Schmuck	0,04
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,04
Edelmetalle und Edelsteine	0,02
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,02
<b>Total</b>	<b>98,43</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	5.293	167.296,13	0,04
USD ADOBE	559	198.280,48	0,05
EUR AIR LIQUIDE	7.420	1.144.164,00	0,26
CHF ALCON INC	841	54.823,88	0,01
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	5.060	1.076.768,00	0,24
USD ALPHABET A	5.860	559.489,90	0,13
USD ALPHABET C	5.420	518.827,37	0,12
USD AMERICAN EXPRESS	3.470	526.831,88	0,12
USD AMERICAN TOWER	1.020	191.842,05	0,04
USD AMGEN	905	201.374,89	0,05
EUR ASML HOLDING	3.120	1.950.624,00	0,44
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	496	101.637,88	0,02
EUR AXA	25.300	712.574,50	0,16
CHF BACHEM HOLDING LTD	49	4.512,44	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	7	13.675,57	0,00
CHF BKW	39	5.650,58	0,00
EUR BMW	3.550	358.337,00	0,08
EUR BNP PARIBAS A	14.000	772.340,00	0,18
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	3.610	230.299,69	0,05
USD CATERPILLAR	2.890	608.723,46	0,14
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	1.060	155.822,67	0,04
USD CISCO SYSTEMS	4.530	217.962,86	0,05
USD COCA-COLA	6.250	356.838,79	0,08
EUR CRH PLC	12.800	594.880,00	0,14
EUR DANONE	8.890	509.485,90	0,12
USD ECOLAB	761	115.944,89	0,03
USD EVANCE HEALTH	406	171.828,30	0,04
USD ELI LILLY & CO	1.370	433.048,37	0,10
EUR ENEL	67.700	380.947,90	0,09
EUR ESSILORLUXOTTICA	3.950	655.700,00	0,15
CHF GEBERIT	120	61.565,74	0,01
CHF GVAUDAN REG	32	95.854,91	0,02
USD HOME DEPOT	1.520	412.888,21	0,09
EUR IBERDROLA	52.090	598.253,65	0,14
USD IBM	988	119.211,12	0,03
EUR INDITEX	11.700	361.530,00	0,08
EUR ING GROUP	46.900	512.617,00	0,12
USD INTEL	4.490	135.016,15	0,03
USD INTUIT	293	120.233,96	0,03
USD JOHNSON & JOHNSON	4.040	576.372,59	0,13
EUR KERING	876	525.600,00	0,12
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	21.763,22	0,00
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	469	25.092,09	0,01
CHF LONZA REG	151	83.282,02	0,02
EUR L'OREAL	3.360	1.381.800,00	0,31
USD LOWE'S COMPANIES	921	169.517,58	0,04
EUR LVMH	2.970	2.507.868,00	0,57
USD MASTERCARD	944	315.761,46	0,07
USD MERCK & CO	4.290	420.095,82	0,10
USD MICROSOFT	8.460	2.244.942,70	0,51
USD MORGAN STANLEY	7.020	567.311,89	0,13
EUR NESTE OYJ	17.300	785.939,00	0,18
CHF NESTLE REG	5.249	589.474,60	0,13
USD NEWMONT MINING	2.160	97.457,96	0,02
USD NIKE B	1.530	172.708,55	0,04
CHF NOVARTIS REG	4.003	337.824,97	0,08
USD NUCOR	647	91.989,59	0,02
USD NVIDIA	2.970	759.332,60	0,17
EUR ORANGE	46.600	510.363,20	0,12
CHF PARTNERS GROUP	48	41.437,18	0,01
USD PEPSICO	1.920	322.164,85	0,07
USD PROCTER & GAMBLE	3.020	413.312,90	0,09
USD PROLOGIS	2.020	231.980,67	0,05
EUR REPSOL	47.300	670.950,50	0,15
CHF ROCHE HOLDING	45	12.468,51	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	1.391	365.724,38	0,08
USD S&P GLOBAL	1.860	590.245,48	0,13
USD SALESFORCE.COM	1.090	200.432,79	0,05
EUR SAP SE	7.960	923.837,60	0,21
USD SCHLUMBERGER	4.990	225.513,37	0,05
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	8.850	1.360.068,00	0,31
USD SEMPRA ENERGY	1.210	168.349,76	0,04
USD SHERWIN-WILLIAMS	609	125.992,85	0,03
CHF SIKA LTD	431	110.952,64	0,03
CHF SONOVA HOLDING REG	99	26.792,34	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	187	25.690,13	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	145	11.110,58	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	766	72.424,62	0,02
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	49	28.792,75	0,01
USD TARGET	683	104.123,79	0,02
USD TESLA MOTORS	3.590	685.518,34	0,16
USD TEXAS INSTRUMENTS	1.090	186.617,79	0,04
CHF THE SWATCH GROUP	42	13.262,27	0,00
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	542	287.535,13	0,07
USD TJX COS	1.570	113.235,95	0,03
CHF UBS GROUP	7.800	151.598,99	0,03
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	3.190	157.538,15	0,04
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	4.000	714.216,02	0,16
USD VALERO ENERGY	1.260	161.899,77	0,04
USD VERIZON COMMUNICATIONS	5.020	179.693,31	0,04
USD VISA A	1.630	338.257,44	0,08
USD WALT DISNEY	1.980	182.481,84	0,04
EUR WOLTERS KLUWER	4.320	502.632,00	0,11

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

**Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)**

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	382	168.464,89	0,04
<b>Total Aktien</b>		<b>37.468.119,54</b>	<b>8,51</b>
<b>Anleihen</b>			
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	4.000.000	3.639.320,00	0,83
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	4.000.000	3.561.691,75	0,81
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	4.000.000	3.237.480,00	0,74
EUR AUSTRIA S 1 1.65%/14-21.10.24	1.500.000	1.473.405,00	0,33
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	750.000	648.598,65	0,15
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	4.000.000	3.579.120,00	0,81
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	2.000.000	1.719.820,00	0,39
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	1.500.000	1.391.400,00	0,32
EUR BNP PARIBAS 1.125%/19-280824	4.000.000	3.862.240,00	0,88
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	1.500.000	1.262.070,00	0,29
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	3.850.000	3.307.458,00	0,75
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	3.350.000	3.100.224,00	0,70
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	521.000	342.250,95	0,08
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	1.000.000	719.158,73	0,16
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA S. -3221A-0.25%/19-30.10.2026	5.500.000	4.936.415,00	1,12
EUR DAIMLER AG 0.75%/20-10.09.2030	3.000.000	2.498.100,00	0,57
EUR E.ON SE 0.875%/20-200831	5.000.000	4.016.000,00	0,91
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	5.000.000	4.813.000,00	1,09
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	3.000.000	2.630.125,64	0,60
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-280728	2.000.000	1.989.300,00	0,45
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.500.000	1.347.480,33	0,31
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	3.000.000	2.421.450,00	0,55
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	1.500.000	1.335.570,00	0,30
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	2.000.000	1.778.520,00	0,40
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	2.000.000	1.821.780,00	0,41
EUR FRANCE OAT 0.5%/15-250525	2.000.000	1.908.060,00	0,43
EUR FRANCE OAT 1.75%/13-250523	3.000.000	2.996.220,00	0,68
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	1.000.000	834.570,00	0,19
EUR GERMANY 0.25%/17-150227	2.000.000	1.845.600,00	0,42
EUR GERMANY 1%/14-150824	1.000.000	976.950,00	0,22
EUR GERMANY 1.5%/13-150523	4.000.000	3.995.560,00	0,91
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	2.000.000	1.811.717,06	0,41
USD ING GROEP NV 2.5%/18-15.11.2030	5.000.000	4.552.200,00	1,03
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	3.000.000	2.556.600,00	0,58
EUR IRELAND 1%/16-150526	2.250.000	2.144.452,50	0,49
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	2.000.000	1.816.720,00	0,41
EUR KFW 0.01%/19-05.05.2027	3.000.000	2.672.490,00	0,61
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	4.500.000	3.693.980,39	0,84
EUR KFW 2.75%/23-140233	4.000.000	3.972.920,00	0,90
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	3.000.000	2.656.109,35	0,60
EUR LEHMAN BROTHERS HOLDINGS FRN/04-21.05.2009	1.000.000	4.250,00	0,00
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	1.000.000	917.474,34	0,21
EUR NEDER WATERSCHAPS BANK S. -1414- 1%/15-03.09.2025	3.000.000	2.846.940,00	0,65
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	3.150.000	2.949.156,00	0,67
EUR OBRIGACOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	4.050.000	3.864.672,00	0,88
EUR OBRIGACOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	2.500.000	2.423.850,00	0,55
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	4.000.000	3.142.600,00	0,71
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	1.000.000	674.716,90	0,15
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	2.000.000	1.839.900,00	0,42
EUR SPAIN 1.6%/14-300425	4.600.000	4.487.346,00	1,02
EUR SPAIN 2.75%/14-311024	4.200.000	4.190.928,00	0,95
EUR TELEFONICA EMISIONES SAU 1.069%/19-05.02.2024	3.000.000	2.942.250,00	0,67
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	1.500.000	1.213.116,11	0,28
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	500.000	330.252,13	0,08
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	2.781.000	1.601.620,79	0,36
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	2.000.000	1.769.668,42	0,40
USD US 4.5%/06-15.02.2036	2.000.000	2.045.078,01	0,46
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	3.000.000	2.674.241,50	0,61
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	800.000	692.795,34	0,16
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	2.000.000	1.773.120,03	0,40
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	3.000.000	2.576.410,00	0,59
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	1.000.000	750.149,57	0,17
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	2.500.000	2.222.398,64	0,51
<b>Total Anleihen</b>		<b>147.799.061,13</b>	<b>33,59</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>		<b>185.267.180,67</b>	<b>42,10</b>

**Nicht börsennotierte Wertpapiere**

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
EUR LEHMAN BROTHERS HOLDINGS FRN 03-03.11.2008 (MATURED)	1.000.000	4.250,00	0,00
<b>Total Anleihen</b>		<b>4.250,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Nicht börsennotierte Wertpapiere</b>		<b>4.250,00</b>	<b>0,00</b>

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermögens
<b>Investmentfonds</b>			
<b>Fondsanteile (Open-End)</b>			
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	14.491	11.077.955,69	2,52
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	568	1.410.485,05	0,32
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	86.991	18.338.572,71	4,17
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	10.902	13.022.694,63	2,96
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	690	1.440.958,65	0,33
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	2.513	4.879.977,92	1,11
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	275.297	36.476.852,50	8,29
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	166.060	23.688.139,17	5,38
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	1.519	214.976,70	0,05
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -OBX USD- USD	370	303.469,49	0,07
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -OBX USD- USD	27.112	22.272.291,52	5,06
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -OBX- USD	15.449	14.717.964,89	3,34
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -OBX EUR ACC- EUR	1.857	2.417.256,90	0,55
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -OBX- JPY	5.242	5.130.464,54	1,17
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -OBX GBP ACC- GBP	2.971	4.191.250,26	0,95
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -OBX USD ACC- USD	3.063	3.406.979,59	0,77
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -OBX CAD ACC- CAD	4.453	3.466.971,00	0,79
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	5.030	7.074.223,11	1,61
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	22.546	23.141.167,09	5,26
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND -EB- USD	1.574	2.743.797,32	0,62
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	411	280.030,04	0,06
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	1.943	2.285.387,91	0,52
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	350	402.336,02	0,09
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	5.367	5.901.946,32	1,34
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	9.716	11.025.059,86	2,51
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	15.276	13.481.461,94	3,06
USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	9.352	891.687,31	0,20
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	108.678	10.567.208,73	2,40
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	26.935	3.636.454,32	0,83
<b>Total Fondsanteile (Open-End)</b>		<b>247.888.021,18</b>	<b>56,33</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>247.888.021,18</b>	<b>56,33</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>433.159.451,85</b>	<b>98,43</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		5.913.548,84	1,34
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-727.474,98	-0,17
Andere Nettvermögenswerte		1.710.867,92	0,40
<b>Fondsvermögen</b>		<b>440.056.393,63</b>	<b>100,00</b>

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%	1,69%
B - Thesaurierend	CHF	672339	LU0078042883	1,30%	1,69%
IB - Thesaurierend	CHF	1057449	LU0108838490	0,60%	0,99%
UA - Ausschüttend	CHF	26362932	LU1144411987	1,05%	1,44%
UB - Thesaurierend	CHF	26362936	LU1144412019	1,05%	1,44%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	CHF	1,63%	/	-14,39%	4,99%	1,36%
B - Thesaurierend	CHF	1,62%	/	-14,38%	4,98%	1,37%
IB - Thesaurierend	CHF	1,81%	/	-13,79%	5,71%	2,08%
UA - Ausschüttend	CHF	1,69%	/	-14,17%	5,24%	1,63%
UB - Thesaurierend	CHF	1,69%	/	-14,17%	5,24%	1,62%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In CHF)
<i>Gegenpartei</i>					
USD	7.800.000	CHF	-7.126.392	12.05.2023	-33.038,93
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	4.000.000	CHF	-3.650.704	12.05.2023	-13.086,64
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CAD	2.050.000	CHF	-1.372.721	12.05.2023	5.595,20
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CAD	1.810.000	CHF	-1.218.284	12.05.2023	-1.331,50
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.200.000	CHF	-1.107.586	12.05.2023	-16.300,51
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.440.000	CHF	-2.248.079	12.05.2023	-29.133,01
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.400.000	CHF	-2.211.727	12.05.2023	-29.157,02
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.340.000	CHF	-1.248.706	12.05.2023	-30.104,12
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	7.450.000	CHF	-6.906.314	12.05.2023	-131.252,31
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	760.000	CHF	-710.240	12.05.2023	-19.092,54
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	2.000.000	CHF	-1.855.768	12.05.2023	-36.959,52
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	10.830.000	CHF	-10.004.166	12.05.2023	-155.318,01
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	12.759.448	EUR	-13.000.000	12.05.2023	-116.074,90
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	275.481.296	USD	-300.100.000	12.05.2023	2.580.727,23
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	318.000.000	CHF	-2.242.176	12.05.2023	-56.042,47
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	51.087.007	EUR	-51.630.000	12.05.2023	-47.755,25

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

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

<b>Käufe</b>	<b>Verkäufe</b>		<b>Fälligkeit</b>	<b>Bewertung</b>	
<i>Gegenpartei</i>				(In CHF)	
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	6.755.926	CAD	-9.870.000	12.05.2023	120.312,06
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften</b>				<b>1.991.987,76</b>	

## Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF

**Nettovermögensaufstellung (in CHF) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		839.282.561,71			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		9.860.527,41			
Forderungen aus Erträgen		1.127.885,58			
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften		1.991.987,76			
Andere Aktiva		30.141,52			
		<b>852.293.103,98</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		1.036.074,56			
Andere Passiva		84,58			
		<b>1.036.159,14</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>851.256.944,84</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>					
		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>CHF</b>	<b>851.256.944,84</b>	<b>1.063.871.007,76</b>	<b>1.159.950.939,59</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A - Ausschüttend	CHF	109,40	119,79	122,47	
B - Thesaurierend	CHF	165,74	181,48	185,55	
IB - Thesaurierend	CHF	1.168,27	1.270,31	1.289,71	
UA - Ausschüttend	CHF	98,07	107,11	109,24	
UB - Thesaurierend	CHF	101,38	110,74	112,94	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>					
		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
A - Ausschüttend	CHF	1.005.487,488	1.169.568,746	9.342,972	173.424,230
B - Thesaurierend	CHF	2.507.047,167	2.790.145,958	151.808,209	434.907,000
IB - Thesaurierend	CHF	16.260,205	23.105,857	0,000	6.845,652
UA - Ausschüttend	CHF	1.296.921,356	1.489.794,126	37.929,917	230.802,687
UB - Thesaurierend	CHF	1.771.031,053	2.063.239,596	55.886,596	348.095,139

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>1.063.871.007,76</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	3.373.719,54
Dividenden (Netto)	3.012.518,08
Bankzinsen	199.366,75
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	67.862,92
Andere Erträge	187.003,90
	<b>6.840.471,19</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	11.218.741,68
Depotbank- und Depotgebühr	588.799,31
Zentralverwaltungsvergütung	565.300,79
Druck- und Veröffentlichungskosten	58.708,51
Zinsen und Bankspesen	6.965,06
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	160.918,98
"Taxe d'abonnement"	234.537,66
	<b>12.833.971,99</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-5.993.500,80</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	96.046,76
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-10.651.459,73
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	1.595.935,96
	<b>-8.959.477,01</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-14.952.977,81</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-74.573.867,01
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-773.146,02
	<b>-75.347.013,03</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-90.299.990,84</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	36.367.892,13
Rücknahmen	-158.681.964,21
	<b>-122.314.072,08</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>851.256.944,84</b>

## Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

## Geographische Aufteilung

Luxemburg	48,64
Vereinigte Staaten	10,06
Schweiz	9,22
Irland	6,21
Supranational	3,74
Deutschland	3,49
Australien	2,90
Frankreich	2,88
Niederlande	2,27
Kanada	1,70
Österreich	1,39
Vereinigte Arabische Emirate	1,06
Finnland	1,03
Spanien	0,99
Norwegen	0,70
Italien	0,60
Chile	0,53
Südkorea	0,38
Belgien	0,21
Neuseeland	0,21
Polen	0,11
Schweden	0,11
Niederländische Antillen	0,06
Portugal	0,06
Mexiko	0,04
<b>Total</b>	<b>98,59</b>

## Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	54,20
Banken und andere Kreditinstitute	16,25
Supranationale Organisationen	4,56
Länder und Zentralregierungen	4,40
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	3,40
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	2,93
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	2,59
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,30
Versicherungsgesellschaften	1,18
Elektrische Geräte und Komponenten	0,82
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,75
Chemie	0,74
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,61
Computerhardware und Netzwerk	0,59
Uhrenindustrie, Schmuck	0,58
Energie- und Wasserversorgung	0,46
Telekommunikation	0,43
Baustoffe und Bauindustrie	0,39
Verkehr und Transport	0,39
Elektronik und Halbleiter	0,25
Gesundheits- und Sozialdienste	0,24
Fahrzeuge	0,21
Grafikverlags- und Druckmedien	0,19
Petroleum	0,17
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,17
Immobilien	0,16
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,14
Einzelhandel und Warenhäuser	0,14
Verschiedene Konsumgüter	0,12
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,07
Biotechnologie	0,06
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,05
Edelmetalle und Edelsteine	0,03
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,03
Fotografie und Optik	0,02
<b>Total</b>	<b>98,59</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	156.147	4.898.331,39	0,58
USD ADOBE	1.350	475.261,29	0,06
EUR AIR LIQUIDE	2.430	371.895,71	0,04
CHF ALCON INC	24.716	1.599.125,20	0,19
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	1.650	348.486,60	0,04
USD ALPHABET A	14.200	1.345.592,30	0,16
USD ALPHABET C	13.100	1.244.587,42	0,15
USD AMERICAN EXPRESS	8.400	1.265.762,94	0,15
USD AMERICAN TOWER	2.460	459.207,81	0,05
USD AMGEN	2.190	489.650,20	0,06
EUR ASML HOLDING	1.020	632.921,22	0,07
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	1.200	244.053,87	0,03
EUR AXA	8.260	238.698,08	0,03
CHF BACHEM HOLDING LTD	1.476	138.300,40	0,02
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	200	387.800,00	0,05
CHF BKW	1.179	169.640,20	0,02
EUR BMW	1.160	116.212,22	0,01
EUR BNP PARIBAS A	4.570	250.417,38	0,03
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	8.740	553.385,92	0,07
USD CATERPILLAR	6.990	1.461.268,04	0,17
CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI	6	648.900,00	0,08
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	31.231	4.558.602,90	0,54
USD CISCO SYSTEMS	11.000	525.300,12	0,06
USD COCA-COLA	15.100	855.656,59	0,10
EUR CRH PLC	4.200	193.731,04	0,02
EUR DANONE	2.910	165.521,31	0,02
USD ECOLAB	1.840	278.237,27	0,03
USD ELEVANCE HEALTH	953	412.907,43	0,05
USD ELI LILLY & CO	3.310	1.038.423,12	0,12
EUR ENEL	22.100	123.424,02	0,01
EUR ESSLORLUXOTTICA	1.290	212.533,95	0,02
CHF GEBERIT	3.554	1.809.696,80	0,21
CHF GVAUDAN REG	959	2.851.107,00	0,33
USD HOME DEPOT	3.690	392.126,92	0,12
EUR IBERDROLA	16.915	192.811,76	0,02
USD IBM	2.390	286.212,26	0,03
EUR INDITEX	3.820	117.152,72	0,01
EUR ING GROUP	15.300	165.974,78	0,02
USD INTEL	10.900	325.309,24	0,04
USD INTUIT	710	289.166,79	0,03
USD JOHNSON & JOHNSON	9.790	1.386.229,58	0,16
EUR KERING	286	170.313,00	0,02
CHF LINDT & SPRUENGLI	52	561.600,00	0,07
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	13.795	732.514,50	0,09
CHF LONZA REG	4.427	2.423.339,80	0,28
EUR L'OREAL	1.100	448.962,19	0,05
USD LOWE'S COMPANIES	2.230	407.371,35	0,05
EUR LVMH	972	814.601,12	0,10
USD MASTERCARD	2.280	756.924,38	0,09
USD MERCK & CO	10.400	1.010.776,00	0,12
USD MICROSOFT	20.500	5.399.073,93	0,63
USD MORGAN STANLEY	17.000	1.363.528,46	0,16
EUR NESTE OYJ	5.660	255.205,30	0,03
CHF NESTLE REG	154.231	17.190.587,26	2,02
USD NEWMONT MINING	5.220	233.756,98	0,03
USD NIKE B	3.710	415.649,08	0,05
CHF NOVARTIS REG	117.828	9.869.273,28	1,16
USD NUCOR	1.570	221.546,34	0,03
USD NVIDIA	7.190	1.824.462,75	0,21
EUR ORANGE	15.200	165.221,87	0,02
CHF PARTNERS GROUP	1.419	1.215.799,20	0,14
USD PEPSICO	4.660	776.056,53	0,09
USD PROCTER & GAMBLE	7.320	994.291,24	0,12
USD PROLOGIS	4.890	557.365,14	0,07
EUR REPSOL	15.500	218.218,49	0,03
CHF ROCHE HOLDING	1.322	363.550,00	0,04
CHF ROCHE HOLDING CERT	40.906	10.674.420,70	1,25
USD S&P GLOBAL	4.490	1.414.153,59	0,17
USD SALESFORCE.COM	2.650	483.636,04	0,06
EUR SAP SE	2.600	299.492,83	0,04
USD SCHLUMBERGER	12.100	542.734,76	0,06
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	2.890	440.804,19	0,05
USD SEMPRA ENERGY	2.920	403.218,55	0,05
USD SHERWIN-WILLIAMS	1.470	301.839,76	0,04
CHF SIKA LTD	12.646	3.231.063,00	0,38
CHF SONOVA HOLDING REG	2.923	785.117,80	0,09
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	5.528	753.742,80	0,09
CHF SWISS PRIME SITE	4.283	325.722,15	0,04
CHF SWISS REINSURANCE	22.513	2.112.619,92	0,25
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	1.447	843.890,40	0,10
USD TARGET	1.650	249.656,98	0,03
USD TESLA MOTORS	8.700	1.648.824,37	0,19
USD TEXAS INSTRUMENTS	2.640	448.601,78	0,05
CHF THE SWATCH GROUP	1.256	393.630,40	0,05
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	1.310	689.752,74	0,08
USD TJX COS	3.790	271.302,88	0,03
CHF UBS GROUP	229.909	4.434.944,61	0,52
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	1.040	50.975,20	0,01
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	9.690	1.717.211,91	0,20
USD VALERO ENERGY	3.060	390.236,26	0,05
USD VERIZON COMMUNICATIONS	12.100	429.876,88	0,05
USD VISA A	3.940	811.496,21	0,10
USD WALT DISNEY	4.790	438.147,66	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)	Nettovermögens	% des	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	Nettovermögens	% des
EUR WOLTERS KLUWER	1.410	162.823,10	0,02		USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	1.000.000	899.064,59	0,11	
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	11.209	4.906.179,30	0,58		CHF INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC	800.000	773.920,00	0,09	
<b>Total Aktien</b>		<b>122.145.544,75</b>	<b>14,35</b>		EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	2.000.000	1.691.617,00	0,20	
<b>Anleihen</b>					USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	2.500.000	2.170.354,37	0,25	
CHF ABN AMRO BANK 0.3%/16-18.12.2024	1.000.000	962.500,00	0,11		EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	1.000.000	901.547,30	0,11	
CHF ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-020328	5.000.000	4.997.500,00	0,59		EUR KFW 0.01%/19-05.05.2027	1.000.000	884.148,78	0,10	
EUR ACEA SPA/21-28.09.2025	1.000.000	903.006,28	0,11		USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	5.000.000	4.073.639,49	0,48	
CHF AFRICA FINANCE CORP 1.205%/20-30.09.2025	5.000.000	4.750.000,00	0,56		EUR KFW 2.75%/23-140233	3.000.000	2.957.342,33	0,35	
CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025	1.000.000	957.000,00	0,11		USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	2.650.000	2.328.633,20	0,27	
CHF APPLE 0.375%/15-25.11.2024	1.000.000	977.000,00	0,11		CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027	1.500.000	1.371.000,00	0,16	
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	2.500.000	2.209.361,91	0,26		CHF MONDELEZ INTERNATIONAL (REG. -S-) 1.125%/15-21.12.2023	1.100.000	1.093.400,00	0,13	
EUR ASIAN DEVELOPMENT BANK 0%/19-24.10.2029	2.000.000	1.644.235,05	0,19		CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028	12.000.000	10.500.000,00	1,23	
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	3.000.000	2.409.899,18	0,28		CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 0.1%/20-17.12.2025	8.000.000	7.496.000,00	0,88	
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	1.000.000	930.895,53	0,11		CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	1.500.000	1.470.000,00	0,17	
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	2.500.000	2.145.780,52	0,25		CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.3%/17-31.10.2025	2.500.000	2.375.000,00	0,28	
CHF BANCO BILBAO SA 2.4075%/22-281125	3.000.000	2.994.000,00	0,35		CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.125%/19-21.06.2027	6.705.000	6.081.435,00	0,71	
CHF BANCO DE CREDITO E 0.5994%/22-260427	5.000.000	4.510.000,00	0,53		USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	1.500.000	1.365.889,93	0,16	
CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	1.750.000	1.534.750,00	0,18		EUR NEDER WATERSCHAPS BANK S. -1414- 1%/15-03.09.2025	1.500.000	1.412.793,98	0,17	
EUR BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026	1.000.000	888.069,15	0,10		EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	750.000	696.913,65	0,08	
CHF BANK OF AMERICA CORP 0.2525%/19-12.06.2026	1.000.000	940.500,00	0,11		CHF NORDEA BANK 0.25%/15-27.11.2023	1.000.000	989.000,00	0,12	
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025	2.500.000	2.175.584,30	0,26		CHF NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025	400.000	385.200,00	0,05	
CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.1425%/21-251028	1.000.000	869.500,00	0,10		CHF NORDEA BANK ABP 0.125%/20-02.06.2026	3.440.000	3.212.960,00	0,38	
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.2%/20-03.11.2028	4.400.000	3.834.600,00	0,45		CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028	6.500.000	5.856.500,00	0,69	
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027	2.000.000	1.846.000,00	0,22		CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025	4.650.000	4.477.950,00	0,53	
CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.25%/19-24.10.2029	1.000.000	844.000,00	0,10		EUR OBRIGACOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	250.000	236.770,80	0,03	
CHF BAWAG P.S.K. 2.955%/22-291127	7.000.000	7.045.500,00	0,83		EUR OBRIGACOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	250.000	240.567,11	0,03	
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	1.000.000	853.460,68	0,10		CHF OEKB 2.625%/06-22.11.2024	3.000.000	3.037.500,00	0,36	
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	1.000.000	920.643,00	0,11		EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	1.500.000	1.169.636,44	0,14	
CHF BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028	1.000.000	891.500,00	0,10		CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	1.000.000	669.656,53	0,08	
CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	1.000.000	941.500,00	0,11		CHF PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029	750.000	681.750,00	0,08	
CHF BNG 1.25%/14-30.04.2024	1.000.000	994.100,00	0,12		CHF QUEBEC 0.75%/14-21.11.2024	1.100.000	1.079.100,00	0,13	
EUR BNP PARIBAS 1.125%/19-280824	2.000.000	1.916.636,60	0,23		CHF RCI BANQUE SA 0.55%/18-30.05.2023	800.000	797.920,00	0,09	
CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LB) 11%/20-24.07.2028	1.355.000	1.179.527,50	0,14		EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	1.000.000	913.050,38	0,11	
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 0.6%/19-31	1.000.000	852.636,90	0,10		CHF ROYAL BANK OF CANADA 0.2%/21-220931	2.000.000	1.610.000,00	0,19	
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	500.000	459.249,60	0,05		CHF SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 0.15%/19-10.12.2024	700.000	673.750,00	0,08	
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	6.000.000	3.911.908,70	0,46		EUR SPAIN 1.6%/14-300425	500.000	484.096,84	0,06	
CHF CANADIAN IMP BK OF COM 0.18%/21-200429	1.000.000	854.500,00	0,10		CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 2.7%/23-200329	3.600.000	3.603.600,00	0,42	
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	1.000.000	914.500,00	0,11		USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	1.500.000	1.204.017,74	0,14	
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.1%/20-24.10.2023	2.000.000	1.980.400,00	0,23		CHF TRANSPOWER NEW ZEALAND LIMITED 0.02%/19-16.12.2027	690.000	622.035,00	0,07	
CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025	2.000.000	1.897.000,00	0,22		CHF TRANSURBAN FINANCE 0.625%/16-23.06.2023	4.410.000	4.397.211,00	0,52	
CHF CENTRAL AMER BANK 0.11%/21-151228	6.000.000	5.217.000,00	0,61		AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	3.000.000	1.966.651,41	0,23	
CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028	3.000.000	2.683.500,00	0,32		AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	4.000.000	2.286.384,23	0,27	
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	500.000	356.882,52	0,04		CHF UBS GROUP FUNDING T. 2 1.25%/16-23.02.2026	600.000	577.800,00	0,07	
CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026	1.400.000	1.310.400,00	0,15		USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	3.000.000	2.634.593,87	0,31	
CHF COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.5%/14-19.02.2024	2.000.000	1.990.400,00	0,23		USD US 4.5%/06-15.02.2036	3.000.000	3.044.609,88	0,36	
CHF COOPERATIVE RABOBANK UA 0.25%/19-25.11.2027	5.000.000	4.442.500,00	0,52		USD US F 2024 2.25%/14-15.11.2024	3.000.000	2.654.184,69	0,31	
CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	1.100.000	1.126.400,00	0,13		USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	2.000.000	1.601.810,22	0,19	
CHF CORPORACION ANDINA 0.45%/22-240227	5.000.000	4.612.500,00	0,54		USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	2.000.000	1.718.988,45	0,20	
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.25%/17-27.07.2027	1.250.000	1.155.625,00	0,14		USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	5.000.000	4.399.554,08	0,52	
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026	2.000.000	1.886.000,00	0,22		USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	7.000.000	5.966.536,15	0,70	
CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.25%/19-24.10.2029	1.000.000	890.500,00	0,10		USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	4.000.000	2.978.093,79	0,35	
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.1637%/21-280428	1.500.000	1.329.000,00	0,16		USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	2.500.000	2.205.730,65	0,26	
CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.25%/19-10.10.2029	3.000.000	2.568.000,00	0,30		CHF WOODSIDE FINANCE 1%/16-111223	5.000.000	4.942.500,00	0,58	
CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.5%/18-18.07.2028	1.900.000	1.754.650,00	0,21		<b>Total Anleihen</b>	<b>255.748.753,70</b>	<b>30,04</b>		
EUR EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025	2.000.000	1.910.761,00	0,22		<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>	<b>377.894.298,45</b>	<b>44,39</b>		
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	2.000.000	1.740.266,46	0,20		<b>Investmentfonds</b>				
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.5%/15-15.11.2023	2.500.000	2.443.361,31	0,29		<b>Fondsanteile (Open-End)</b>				
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	2.500.000	2.019.120,19	0,24		USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	27.553	20.905.505,58	2,46	
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75%/23-280728	3.000.000	2.961.570,38	0,35		EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	1.477	3.640.917,69	0,43	
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1.000.000	891.582,82	0,10		EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	40.320	8.436.110,26	0,99	
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	2.000.000	1.602.192,75	0,19		USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	21.634	25.648.542,00	3,01	
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	750.000	662.776,61	0,08		USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	1.129	2.340.587,41	0,27	
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	2.000.000	1.765.181,10	0,21		USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	4.093	7.888.558,10	0,93	
CHF FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C. 0.068%/21-31.03.2027	10.000.000	9.020.000,00	1,06		EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	194.440	25.570.075,25	3,00	
EUR FRANCE OAT 0.5%/15-250525	1.000.000	946.874,78	0,11		USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	180.052	25.491.440,49	2,99	
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	1.000.000	801.910,23	0,09		USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	5.242	736.310,78	0,09	
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	500.000	414.155,36	0,05						
EUR GERMANY 1.5%/13-150523	350.000	346.989,41	0,04						
CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029	1.010.000	848.400,00	0,10						
CHF HYUNDAI CAPIT SRV INC 3.0325%/23-010228	3.220.000	3.250.590,00	0,38						

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 CHF

## Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in CHF)	% des Nettovermö- gens
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL - OBX USD- USD	624	507.281,44	0,06
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD - OBX USD- USD	50.730	41.361.732,76	4,86
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - OBX- USD	30.074	28.436.038,95	3,34
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE - OBX EUR ACC- EUR	1.548	1.999.918,86	0,23
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE - OBX- JPY	8.643	8.395.657,28	0,99
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE - OBX GBP ACC- GBP	3.903	5.464.746,34	0,64
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE - OBX USD ACC- USD	3.942	4.351.807,45	0,51
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE - OBX CAD ACC- CAD	8.432	6.515.663,20	0,77
USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	8.490	11.850.835,60	1,39
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	65.153	66.371.355,70	7,80
CHF CS INVESTMENT FUNDS 14 - CREDIT SUISSE (LUX) SWISS FRANC BOND FUND -EB-	500.000	57.185.000,00	6,72
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	2.755	4.766.498,04	0,56
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	602	407.089,42	0,05
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	3.351	3.911.938,96	0,46
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	10.278	11.726.272,98	1,38
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	11.621	12.683.458,04	1,49
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	20.233	22.786.847,55	2,68
USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	29.344	25.702.606,63	3,02
USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	16.397	1.551.683,00	0,18
USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	210.133	20.278.854,75	2,38
USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	33.396	4.474.928,75	0,53
<b>Total Fondsanteile (Open-End)</b>		<b>461.388.263,26</b>	<b>54,20</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>461.388.263,26</b>	<b>54,20</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>839.282.561,71</b>	<b>98,59</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		9.860.527,41	1,16
Andere Nettovermögenswerte		2.113.855,72	0,25
<b>Fondsvermögen</b>		<b>851.256.944,84</b>	<b>100,00</b>

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%	1,70%
EB - Thesaurierend	USD	28145654	LU1230137199	0,60%	0,99%
IB - Thesaurierend	USD	28234308	LU1230137439	0,60%	1,00%
UA - Ausschüttend	USD	26362951	LU1144412100	1,05%	1,45%
UB - Thesaurierend	USD	26364579	LU1144412282	1,05%	1,45%
BH - Thesaurierend	JPY	36829010	LU1614284344	1,30%	1,78%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Ausschüttend	USD	3,30%	/	-14,34%	5,01%	7,98%
B - Thesaurierend	USD	3,30%	/	-14,34%	5,01%	7,98%
EB - Thesaurierend	USD	3,48%	/	-13,72%	5,77%	8,76%
IB - Thesaurierend	USD	3,48%	/	-13,74%	5,75%	8,73%
UA - Ausschüttend	USD	3,36%	/	-14,12%	5,27%	8,25%
UB - Thesaurierend	USD	3,36%	/	-14,12%	5,27%	8,25%
BH - Thesaurierend	JPY	1,93%	/	-16,45%	4,50%	6,61%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (In USD)
<i>Gegenpartei</i>					
JPY	378.139.400	USD	-2.801.223	13.04.2023	45.260,26
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
JPY	359.123.400	USD	-2.729.000	26.04.2023	-20.577,23
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CAD	630.000	USD	-469.834	12.05.2023	-4.056,14
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
JPY	154.000.000	USD	-1.182.637	12.05.2023	-18.474,81
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	1.506.406	CAD	-2.020.000	12.05.2023	12.953,05
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	260.000	USD	-283.681	12.05.2023	-522,34
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	946.777	EUR	-880.000	12.05.2023	-11.577,95
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
USD	15.122.120	EUR	-14.030.000	12.05.2023	-157.166,52
<i>Citibank N.A. - London - United Kingdom</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften</b>					<b>-154.161,68</b>

**Nettovermögensaufstellung (in USD) und Fondsentwicklung**

		<b>31.03.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		283.406.630,11			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.557.160,00			
Forderungen aus Erträgen		526.730,21			
Andere Aktiva		592,80			
		<b>286.491.113,12</b>			
<b>Passiva</b>					
Rückstellungen für Aufwendungen		342.570,14			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		154.161,68			
		<b>496.731,82</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>285.994.381,30</b>			
<b>Fondsentwicklung</b>		<b>31.03.2023</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>31.03.2021</b>	
<b>Fondsvermögen</b>	<b>USD</b>	<b>285.994.381,30</b>	<b>402.188.276,98</b>	<b>395.362.518,61</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A - Ausschüttend	USD	154,69	165,85	166,52	
B - Thesaurierend	USD	284,18	304,69	305,91	
EB - Thesaurierend	USD	1.210,94	1.289,04	1.284,89	
IB - Thesaurierend	USD	1.203,38	1.281,24	1.277,39	
UA - Ausschüttend	USD	111,62	119,38	119,55	
UB - Thesaurierend	USD	116,77	124,89	125,07	
BH - Thesaurierend	JPY	9.741,00	10.833,00	10.931,00	
<b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>		<b>am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Anteile</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Anteile</b>
A - Ausschüttend	USD	114.127,910	146.801,869	7.164,396	39.838,355
B - Thesaurierend	USD	576.052,825	790.348,275	31.844,747	246.140,197
EB - Thesaurierend	USD	5.806,580	6.390,867	958,796	1.543,083
IB - Thesaurierend	USD	34.914,687	41.123,384	3.694,498	9.903,195
UA - Ausschüttend	USD	148.652,484	220.937,863	7.114,933	79.400,312
UB - Thesaurierend	USD	286.095,798	340.357,315	40.856,767	95.118,284
BH - Thesaurierend	JPY	76.400,289	80.908,574	7.521,312	12.029,597

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

<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>402.188.276,98</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	2.279.144,32
Dividenden (Netto)	595.015,43
Bankzinsen	83.797,34
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	9.868,64
Andere Erträge	96.505,93
	<b>3.064.331,66</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	3.859.770,52
Depotbank- und Depotgebühr	209.736,23
Zentralverwaltungsvergütung	201.615,65
Druck- und Veröffentlichungskosten	26.438,62
Zinsen und Bankspesen	262,71
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	109.203,29
"Taxe d'abonnement"	75.498,83
	<b>4.482.525,85</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>-1.418.194,19</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.682.180,60
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	774.909,93
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-152.068,40
	<b>-3.059.339,07</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>-4.477.533,26</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-24.675.212,26
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-262.515,36
	<b>-24.937.727,62</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>-29.415.260,88</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	21.589.215,23
Rücknahmen	-108.367.850,03
	<b>-86.778.634,80</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>285.994.381,30</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

## Geographische Aufteilung

Luxemburg	49,55
Vereinigte Staaten	26,22
Irland	11,44
Supranational	3,14
Niederlande	1,64
Australien	1,39
Norwegen	1,35
Deutschland	0,89
Mexiko	0,82
Schweiz	0,63
Frankreich	0,55
Italien	0,33
Finnland	0,29
Kanada	0,27
Belgien	0,16
Spanien	0,15
Niederländische Antillen	0,12
Österreich	0,09
Polen	0,07
<b>Total</b>	<b>99,10</b>

## Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	60,53
Länder und Zentralregierungen	13,98
Banken und andere Kreditinstitute	6,64
Supranationale Organisationen	3,14
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	2,40
Computerhardware und Netzwerk	1,60
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,35
Telekommunikation	1,30
Energie- und Wasserversorgung	1,27
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	1,12
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	0,86
Verkehr und Transport	0,68
Elektronik und Halbleiter	0,38
Fahrzeuge	0,37
Grafikverlags- und Druckmedien	0,33
Baustoffe und Bauindustrie	0,32
Maschinenbau und Industrieanlagen	0,32
Kantone, Bundesländer, Provinzen	0,27
Petroleum	0,25
Immobilien	0,23
Einzelhandel und Warenhäuser	0,23
Verschiedene Konsumgüter	0,22
Versicherungsgesellschaften	0,19
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,17
gemeinnützige öffentliche Einrichtungen	0,17
Elektrische Geräte und Komponenten	0,14
Chemie	0,14
Biotechnologie	0,11
Beherbergungs- und Cateringindustrie, Freizeiteinrichtungen	0,10
Gesundheits- und Sozialdienste	0,10
Edelmetalle und Edelsteine	0,05
Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie	0,05
Uhrenindustrie, Schmuck	0,04
Fotografie und Optik	0,02
<b>Total</b>	<b>99,10</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
CHF ABB REG	3.325	114.178,78	0,04
USD ADOBE	777	299.432,49	0,10
EUR AIR LIQUIDE	619	103.701,44	0,04
CHF ALCON INC	528	37.395,34	0,01
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	421	97.333,75	0,03
USD ALPHABET A	8.150	845.399,50	0,30
USD ALPHABET C	7.540	784.160,00	0,27
USD AMERICAN EXPRESS	4.830	796.708,50	0,28
USD AMERICAN TOWER	1.420	290.162,80	0,10
USD AMGEN	1.260	304.605,00	0,11
EUR ASML HOLDING	260	176.604,62	0,06
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING	690	153.614,70	0,05
EUR AXA	2.110	64.565,71	0,02
CHF BACHEM HOLDING LTD	31	3.101,61	0,00
CHF BARRY CALLEBAUT (REG. SHARES)	5	10.612,73	0,00
CHF BKW	25	3.935,30	0,00
EUR BMW	295	32.351,55	0,01
EUR BNP PARIBAS A	1.170	70.180,00	0,02
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	5.030	348.629,30	0,12
USD CATERPILLAR	4.020	919.936,80	0,32
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	665	106.207,74	0,04
USD CISCO SYSTEMS	6.300	329.332,50	0,12
USD COCA-COLA	8.690	539.040,70	0,19
EUR CRH PLC	1.070	54.027,26	0,02
EUR DANONE	741	46.137,96	0,02
USD ECOLAB	1.060	175.461,80	0,06
USD ELEVANCE HEALTH	565	259.792,65	0,09
USD ELI LILLY & CO	1.900	652.498,00	0,23
EUR ENEL	5.640	34.479,88	0,01
EUR ESSILORLUXOTTICA	329	59.335,38	0,02
CHF GEBERIT	75	41.805,06	0,01
CHF GIVAUDAN REG	20	65.068,48	0,02
USD HOME DEPOT	2.110	622.703,20	0,22
EUR IBERDROLA	4.287	53.492,67	0,02
USD IBM	1.370	179.593,30	0,06
EUR INDITEX	973	32.664,88	0,01
EUR ING GROUP	3.910	46.430,85	0,02
USD INTEL	6.250	204.187,50	0,07
USD INTUIT	408	181.898,64	0,06
USD JOHNSON & JOHNSON	5.630	872.650,00	0,31
EUR KERING	73	47.586,51	0,02
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	23.644,65	0,01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	293	17.031,05	0,01
CHF LONZA REG	96	57.524,82	0,02
EUR L'OREAL	280	125.104,72	0,04
USD LOWE'S COMPANIES	1.280	255.961,60	0,09
EUR LVMH	248	227.514,80	0,08
USD MASTERCARD	1.310	476.067,10	0,17
USD MERCK & CO	5.960	634.084,40	0,22
USD MICROSOFT	11.800	3.401.940,00	1,19
USD MORGAN STANLEY	9.760	856.928,00	0,30
EUR NESTLE OYJ	1.440	71.074,69	0,02
CHF NESTLE REG	3.288	401.171,50	0,14
USD NEWMONT MINING	3.000	147.060,00	0,05
USD NIKE B	2.130	261.223,20	0,09
CHF NOVARTIS REG	2.512	230.322,06	0,08
USD NUCOR	900	139.023,00	0,05
USD NVIDIA	4.130	1.147.190,10	0,40
EUR ORANGE	3.880	46.167,35	0,02
CHF PARTNERS GROUP	29	27.199,23	0,01
USD PEPSICO	2.690	488.564,00	0,17
USD PROCTER & GAMBLE	4.210	625.984,90	0,22
USD PROLOGIS	2.810	350.603,70	0,12
EUR REPSOL	3.940	60.720,50	0,02
CHF ROCHE HOLDING	27	8.127,85	0,00
CHF ROCHE HOLDING CERT	872	249.088,12	0,09
USD S&P GLOBAL	2.580	889.506,60	0,31
USD SALESFORCE.COM	1.520	303.665,60	0,11
EUR SAP SE	663	83.599,92	0,03
USD SCHLUMBERGER	6.940	340.754,00	0,12
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	737	123.053,67	0,04
USD SEMPRA ENERGY	1.690	253.948,80	0,09
USD SHERWIN-WILLIAMS	847	190.380,19	0,07
CHF SIKA LTD	269	75.235,43	0,03
CHF SONOVA HOLDING REG	62	18.229,59	0,01
CHF STRAUMANN HOLDING LTD	118	17.612,31	0,01
CHF SWISS PRIME SITE	90	7.492,40	0,00
CHF SWISS REINSURANCE	480	49.306,99	0,02
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	31	19.790,58	0,01
USD TARGET	950	157.348,50	0,06
USD TESLA MOTORS	5.000	1.037.300,00	0,36
USD TEXAS INSTRUMENTS	1.520	282.735,20	0,10
CHF THE SWATCH GROUP	27	9.262,79	0,00
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	754	434.582,98	0,15
USD TJX COS	2.180	170.824,80	0,06
CHF UBS GROUP	4.895	103.362,77	0,04
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA	266	14.272,05	0,00
USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	5.570	1.080.524,30	0,38
USD VALERO ENERGY	1.760	245.696,00	0,09
USD VERIZON COMMUNICATIONS	6.980	271.452,20	0,09
USD VISA A	2.260	509.539,60	0,18
USD WALT DISNEY	2.750	275.357,50	0,10
EUR WOLTERS KLUWER	360	45.507,04	0,02

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 Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
CHF ZÜRICH INSURANCE GROUP REG	240	114.991,84	0,04	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	15.676	13.990.986,76	4,89
<b>Total Aktien</b>		<b>27.515.679,87</b>	<b>9,62</b>	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE - QBX- USD	9.278	9.603.101,12	3,36
<b>Anleihen</b>				EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	1.531	2.165.189,14	0,76
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	4.000.000	3.869.600,00	1,35	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	2.161	2.297.863,28	0,80
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	2.000.000	1.940.860,00	0,68	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	1.368	2.096.702,35	0,73
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 2.124%/19-01.10.2030	250.000	219.835,01	0,08	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	1.171	1.415.106,66	0,49
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	250.000	254.753,51	0,09	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	2.631	2.225.502,60	0,78
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	3.500.000	3.288.460,00	1,15	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND EB USD	2.760	4.217.252,40	1,47
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025	2.500.000	2.381.525,00	0,83	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	40.039	44.648.690,07	15,61
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	500.000	467.124,61	0,16	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	1.122	2.124.955,80	0,74
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	550.000	392.535,90	0,14	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND -EBP USD- USD	239	176.917,36	0,06
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	3.000.000	2.343.990,00	0,82	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	1.420	1.814.618,00	0,63
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	1.000.000	952.500,00	0,33	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	219	273.510,96	0,10
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	2.000.000	1.768.200,00	0,62	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	3.521	4.206.679,54	1,47
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	2.000.000	1.951.960,00	0,68	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	5.896	7.268.765,68	2,54
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	1.000.000	876.928,12	0,31	USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	8.927	8.559.386,14	2,99
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	270.000	261.185,40	0,09	USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND EB USD CAP	5.787	599.475,33	0,21
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 1.5%/22-150932	500.000	483.068,26	0,17	USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	64.840	6.849.697,60	2,40
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	300.000	296.890,93	0,10	USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	12.534	1.838.487,12	0,64
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	200.000	175.563,80	0,06	<b>Total Fondsanleihen (Open-End)</b>		<b>173.115.483,30</b>	<b>60,53</b>
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	200.000	181.343,72	0,06	<b>Total Investmentfonds</b>		<b>173.115.483,30</b>	<b>60,53</b>
EUR GERMANY 1%/14-150824	250.000	265.351,83	0,09	<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>283.406.630,11</b>	<b>99,10</b>
EUR GERMANY 1.5%/13-150523	250.000	271.311,01	0,09	Bareinlagen bei Banken und Brokern		2.557.160,00	0,89
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	4.000.000	3.936.680,00	1,38	Andere Nettovermögenswerte		30.591,19	0,01
EUR INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027	500.000	498.897,84	0,17	<b>Fondsvermögen</b>		<b>285.994.381,30</b>	<b>100,00</b>
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	750.000	694.404,52	0,24				
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	2.500.000	2.375.800,00	0,83				
EUR IRELAND 1%/16-150526	100.000	103.548,46	0,04				
EUR IRISH TSY 1.35% 2031 1.35%/18-180331	1.000.000	986.887,72	0,35				
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	2.000.000	1.783.700,00	0,62				
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	4.000.000	3.847.640,00	1,35				
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	3.500.000	3.488.765,00	1,22				
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	200.000	170.713,89	0,06				
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	500.000	366.523,09	0,13				
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	200.000	199.895,94	0,07				
EUR SPAIN 2.75%/14-311024	250.000	271.025,82	0,09				
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	2.000.000	1.757.320,00	0,61				
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	500.000	358.802,42	0,13				
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	218.000	136.403,32	0,05				
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	3.000.000	2.883.984,39	1,01				
USD US 4.5%/06-15.02.2036	5.000.000	5.554.687,50	1,94				
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	2.500.000	2.421.191,40	0,85				
USD US TREASURY 1.625%/16-150526	3.000.000	2.808.515,64	0,98				
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	2.000.000	1.753.437,50	0,61				
USD US TREASURY N/B 1.625%/19-30.11.2026	2.000.000	1.856.093,76	0,65				
USD US TREASURY N/B 1.875%/19-31.07.2026	3.500.000	3.292.460,96	1,15				
USD US TREASURY N/B 2.125%/17-290224	4.500.000	4.396.640,63	1,54				
USD US TREASURY N/B 2.225%/17-151127	3.000.000	2.822.578,14	0,99				
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	2.000.000	1.926.406,26	0,67				
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	3.000.000	2.799.140,64	0,98				
USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	4.000.000	3.260.000,00	1,14				
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	3.500.000	3.380.335,00	1,18				
<b>Total Anleihen</b>		<b>82.775.466,94</b>	<b>28,94</b>				
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>		<b>110.291.146,81</b>	<b>38,56</b>				
<b>Investmentfonds</b>							
<b>Fondsanteile (Open-End)</b>							
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITY ALLOCATION FUND -EB- USD	8.544	7.096.304,64	2,48				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	132	356.991,62	0,12				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR	16.087	3.684.478,40	1,29				
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	6.455	8.376.850,30	2,93				
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND EB USD	831	1.886.155,32	0,66				
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	1.116	2.354.603,32	0,82				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	69.130	9.951.583,23	3,48				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	146.061	22.636.533,78	7,92				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	1.563	240.326,88	0,08				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	178	158.867,90	0,06				

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

## Ungeprüfte Informationen

### Vergütung

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

#### Gesamtvergütung OGAW

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### Allgemeine Informationen im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ("SFT")

#### Arten von SFT

Am 31.03.2023 war der Fonds an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

#### Wiederverwendung von Sicherheiten

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

## Ungeprüfte Informationen

### Verwahrung von Sicherheiten

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

### Abwicklung und Clearing

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

### Fälligkeitstermin und Sicherheiten

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

### Ergänzende Informationen zu Wertpapierleihgeschäften

Zum 31.03.2023 partizipierten die Subfonds ausschliesslich am Wertpapierleihsystem mit Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich (der "Principal").

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

Subfonds	Währung	Umfang der verliehenen Wertpapiere als Anteil vom gesamten verleihbaren Vermögen (in %)*	Summe des Wertpapierleihgeschäftes im Vergleich zum Nettoinventarwert (%)
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	0,35	0,35
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	0,30	0,30
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	0,12	0,11
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	0,12	0,11
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	0,19	0,19
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	0,04	0,04
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	1,86	1,83
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	0,67	0,66
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	0,08	0,08

\* ohne Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

### Daten zu Emittenten von Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte

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

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

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

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

Subfonds	
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	0,16%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	0,36%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	0,05%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	0,02%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	0,07%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	0,01%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	1,08%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	0,76%
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	0,03%

## Ungeprüfte Informationen

Fälligkeit der Sicherheiten in Verbindung mit SFT

Subfonds	Währung	Fälligkeit der Sicherheit						
		Weniger als 1 Tag	Von 1 Tag bis 1 Woche	Von 1 Woche bis 1 Monat	Von 1 Monat bis 3 Monate	Von 3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced EUR	EUR	0,00	0,00	3.061,16	106.174,69	151.237,10	773.290,07	183.065,18
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced CHF	CHF	0,00	0,00	7.047,14	244.426,33	348.165,18	1.780.202,57	421.437,07
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD	USD	0,00	0,00	968,63	33.596,37	47.855,26	244.688,64	57.926,48
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth EUR	EUR	0,00	0,00	357,26	12.391,21	17.650,26	90.247,51	21.364,79
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth CHF	CHF	0,00	0,00	1.297,70	45.009,99	64.113,02	327.816,14	77.605,70
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD	USD	0,00	0,00	177,27	6.148,50	8.758,03	44.780,65	10.601,17
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield EUR	EUR	0,00	0,00	21.291,64	738.488,80	1.051.916,48	5.378.551,66	1.273.293,89
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield CHF	CHF	0,00	0,00	14.873,71	515.886,51	734.837,85	3.757.297,68	889.485,59
Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD	USD	0,00	0,00	575,12	19.947,66	28.413,80	145.282,54	34.393,53

## 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:** CS (Lux) Portfolio Fund  
Balanced EUR

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 529900BYZW6JVJ8J1054

**Ökologische und/oder soziale Merkmale**

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

●● <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	●● <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 29,37% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 19,68%, AA: 30,69%, A: 26,39%, BBB: 11,94%, BB: 3,70%, B: 0,75%, CCC: 0,09%, Nicht bewertbar**: 2,00%, Keine Datenabdeckung**: 4,76%,	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	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 Unternehmensführung	5,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 34,17%, Gelb: 24,40%, Orange: 19,71%, Rot: 0,20%, Nicht bewertbar**: 18,24%, Keine Datenabdeckung**: 2,55%	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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 17,43%, Neutral: 21,20%, Negativ: 2,53%, Kein Rating: 0,38%, Nicht bewertbar**: 58,46%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

**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?**

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	10'956.91	81,52	77,63
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2'918.31	81,52	77,63
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	79'429.29	81,52	77,58
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	93'162.99	81,52	77,41
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	286.82	81,52	77,41

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	653,09	81,52	78,37
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	8,21	81,52	79,47
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	48,88	81,52	71,00
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	81,52	72,92
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	81,52	72,92
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,15	81,52	72,92
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,07	81,52	72,92
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	81,52	72,92
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	81,52	72,92
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	81,52	72,92
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	81,52	72,92
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	81,52	72,92
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	81,52	79,47
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	994,64	81,52	0,66
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	2'888,97	81,52	31,39
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,20	81,52	79,68
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)	35,35	81,52	79,32
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,53	81,52	20,42
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	26,91	81,52	78,23
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	81,52	79,47
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	58,28	15,69	13,11
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	15,69	13,11

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	2,17	15,69	13,11
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	1,99	Vereinigte Staaten von Amerika
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,98	Global
LVMH	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,58	Frankreich
ASML HOLDING NV	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,46	Niederlande
LOREAL SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,98	Frankreich
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,74	Taiwan, Volksrepublik China
VERIZON COMMUNICATIONS INC / 3,88% / 08.02.2029	J. Information und Kommunikation	0,67	Vereinigte Staaten von Amerika
ALLIANZ	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,67	Deutschland
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,67	Vereinigte Staaten von Amerika
INTESA SANPAOLO SPA / 0,75% / 16.03.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,64	Italien
SCHNEIDER ELECTRIC	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,60	Frankreich
EUROPEAN INVESTMENT BANK / 2,75% / 28.07.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,60	Supranational
KFW / 2,75% / 14.02.2033	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,60	Deutschland
TESLA INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,58	Vereinigte Staaten von Amerika
AXA SA	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,55	Frankreich

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

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

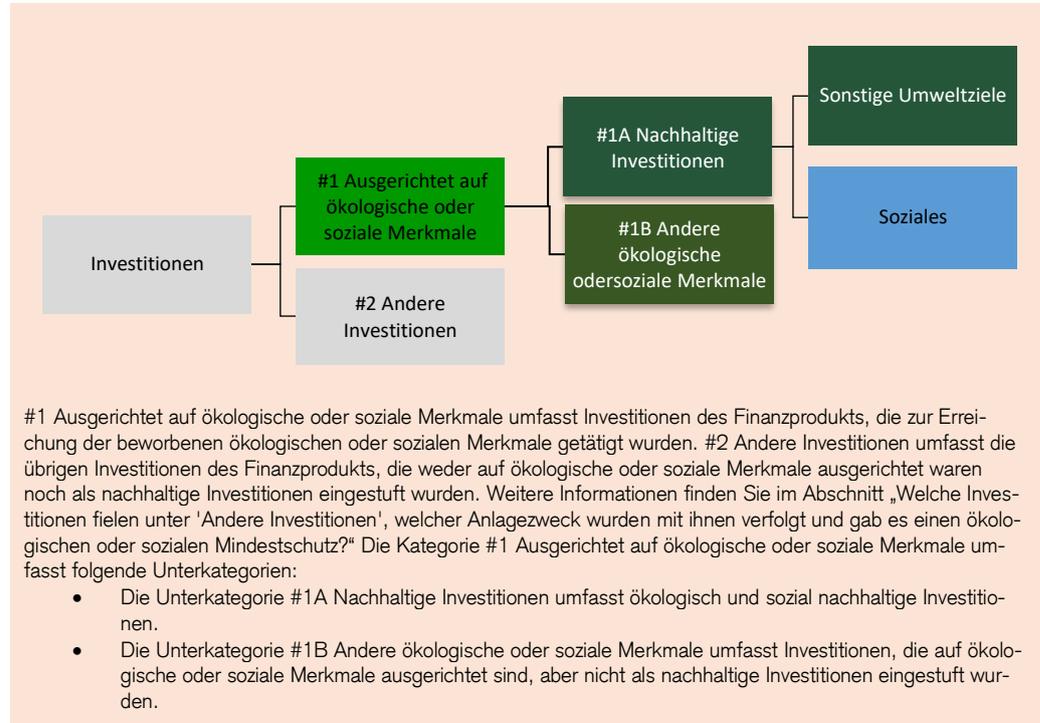
31.03.2023



## 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 90,97% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 29,37% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

#### Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,51%
C. Verarbeitendes Gewerbe	27,16%
D. Energieversorgung	3,32%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,18%
F. Baugewerbe	0,69%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,55%
H. Verkehr und Lagerei	2,23%
I. Gastgewerbe	0,34%
J. Information und Kommunikation	11,42%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	28,57%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,14%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,03%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,44%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	13,32%
P. Bildung	0,04%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,31%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,07%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,42%
Sonstiges	2,22%

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

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,68%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,05%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,18%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,73%
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 Mineralölzerzeugnissen	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 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup> ?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

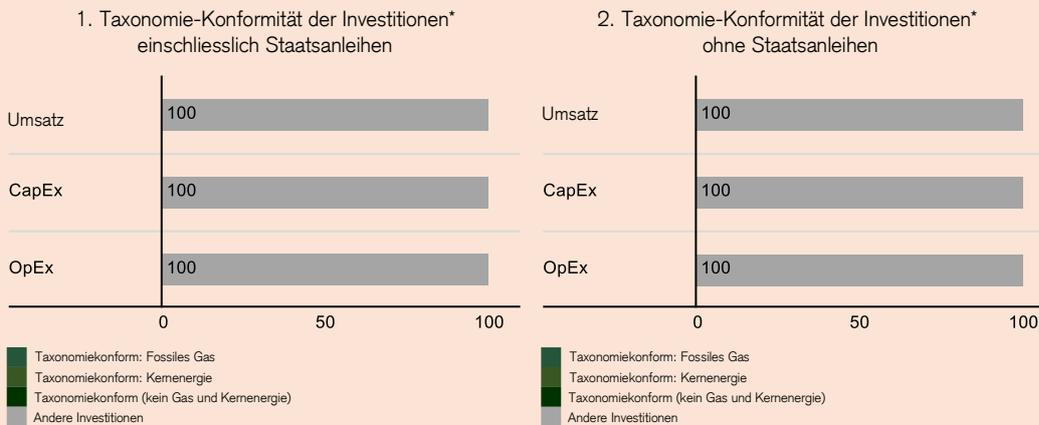
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Zum 31.03.2023 waren 26,94% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 2,43% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 9,03% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

Anlagen wie z. B. Liquidität, Derivate und strukturierte Produkte können unter "Andere Investitionen" gefallen sein, da diese Instrumente nicht zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen dieses Subfonds 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 an und wirkte auf Unternehmen ein, in die investiert wird. Dieser Subfonds schloss Anlagen in Unternehmen der folgenden drei Kategorien aus:

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

## ANHANG IV

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

Name des Produkts: CS (Lux) Portfolio Fund  
Balanced CHF

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900LSWGYDQPWRPP11

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,22% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 13,26%, AA: 34,56%, A: 27,54%, BBB: 11,30%, BB: 4,91%, B: 1,00%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,73%, Keine Datenabdeckung**: 5,58%	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	6,35	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)
ESG-Klassifizierung von 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: 51,6%	Portfolioengagement nach ESG-Klassifizierung der Zielfonds: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 35,45%, Gelb: 21,65%, Orange: 21,55%, Rot: 0,06%, Nicht bewertbar**: 17,71%, Keine Datenabdeckung**: 2,86%	Anlagenexposure nach Warnsignal ESG-Kontroversen: Grün: 0–100% Gelb: 0–100% Orange: 0–100% Rot: 0–100%
ESG-Ausschlüsse von CSAM**	Vor und nach Transaktionen werden Prüfungen durchgeführt, um Investitionen zu erkennen, die gegen die ESG-Ausschlüsse verstoßen.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 15,35%, Neutral: 22,89% Negativ: 2,74%, Kein Rating: 0,87%, Nicht bewertbar**: 58,15%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

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?*

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

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	18'165.86	83,35	74,46
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	5'400.10	83,35	74,46
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	166'005.12	83,35	74,39
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	189'252.66	83,35	74,10
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	213,40	83,35	74,10

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	606,17	83,35	78,80
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	4,66	83,35	80,38
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	49,50	83,35	69,24
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,35	71,47
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	83,35	71,47
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,12	83,35	71,47
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,04	83,35	71,47
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,35	71,47
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,35	71,47
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	83,35	71,47
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	83,35	71,47
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	83,35	71,47
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	83,35	80,38
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	2'624,24	83,35	0,46
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	7'701,99	83,35	27,14
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,06	83,35	80,50
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	36,40	83,35	80,16
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,20	83,35	19,82
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	25,52	83,35	78,33
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	83,35	80,38
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	51,72	14,14	11,08
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	14,14	11,08

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	1,97	14,14	11,08
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	3,58	Schweiz
ROCHE HOLDING PAR AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,23	Schweiz
NOVARTIS AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,05	Schweiz
GL HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,97	Global
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	1,68	Vereinigte Staaten von Amerika
ZURICH INSURANCE GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,04	Schweiz
ABB LTD	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,04	Schweiz
COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,94	Schweiz
UBS GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,92	Schweiz
BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT UND OESTERREICHISCHE P / 2,96% / 29.11.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,82	Österreich
MUENCHENER HYPOTHEKENBK EG / 0,25% / 18.09.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,73	Deutschland
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,71	Taiwan, Volksrepublik China
SIKA AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,68	Schweiz
GIVAUDAN SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,60	Schweiz
ABN AMRO BANK NV / 2,63% / 02.03.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,60	Niederlande

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

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

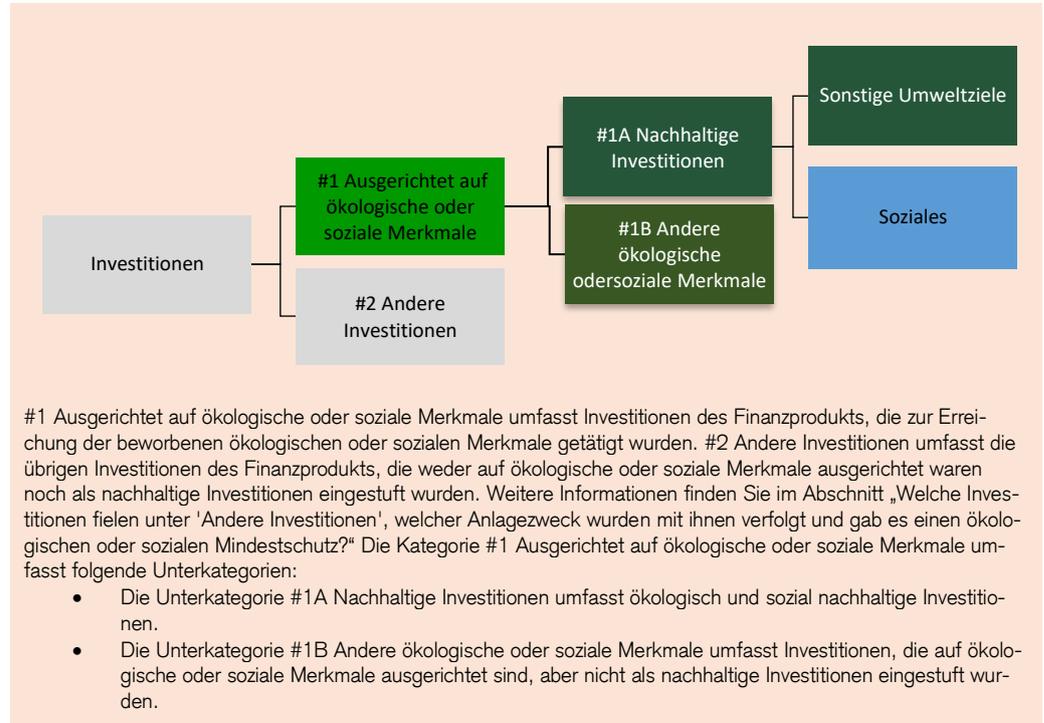
31.03.2023



## 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 90,84% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 24,22% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

#### Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,42%
C. Verarbeitendes Gewerbe	30,06%
D. Energieversorgung	1,39%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,15%
F. Baugewerbe	0,51%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,89%
H. Verkehr und Lagerei	1,82%
I. Gastgewerbe	0,31%
J. Information und Kommunikation	8,80%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	32,47%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,28%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,90%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,76%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	11,87%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,30%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,06%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,44%
Sonstiges	2,49%

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

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,59%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,12%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,15%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,81%
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 Mineralölzerzeugnissen	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 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup> ?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

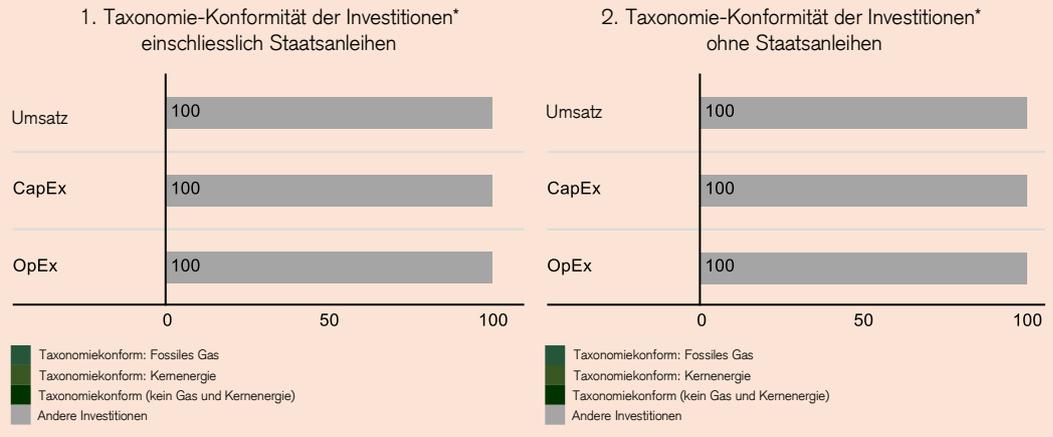
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 22,43% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 1,79% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 9,16% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

## ANHANG IV

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

Name des Produkts: CS (Lux) Portfolio Fund Balanced USD

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900163C5F373ST027

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,87% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,14%, AA: 28,46%, A: 32,21%, BBB: 13,42%, BB: 4,17%, B: 0,65%, CCC: 0,09%, Nicht bewertbar**: 1,68%, Keine Datenabdeckung**: 4,17%,	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	5,43	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	5,74	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 33,89%, Gelb: 22,22%, Orange: 20,72%, Rot: 0,04%, Nicht bewertbar**: 20,62%, Keine Datenabdeckung**: 1,78%	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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 13,26%, Neutral: 25,44%, Negativ: 2,42%, Kein Rating: 0,39%, Nicht bewertbar**: 58,49%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

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?

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	7'284.48	80,20	76,56
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	2'176.09	80,20	76,56
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	63'989.32	80,20	76,48
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	73'220.66	80,20	76,24
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	254,98	80,20	76,24

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	648,11	80,20	77,79
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	6,71	80,20	78,60
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	47,42	80,20	67,61
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	80,20	70,09
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	80,20	70,09
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,13	80,20	70,09
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,05	80,20	70,09
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	80,20	70,09
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	80,20	70,09
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	80,20	70,09
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	80,20	70,09
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	80,20	70,09
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	80,20	78,60
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	957,62	80,20	0,48
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	2'801,07	80,20	26,13
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,05	80,20	78,86
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)	43,92	80,20	78,38
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,29	80,20	19,43
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	24,86	80,20	77,24
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	80,20	78,60
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	66,29	17,32	15,61
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	17,32	15,61

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	2,16	17,32	15,61
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	3,30	Vereinigte Staaten von Amerika
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,96	Global
UNITED STATES TREASURY / 2,38% / 15.05.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,18	Vereinigte Staaten von Amerika
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,11	Vereinigte Staaten von Amerika
VERIZON COMMUNICATIONS INC / 3,88% / 08.02.2029	J. Information und Kommunikation	1,06	Vereinigte Staaten von Amerika
TESLA INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,95	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	0,91	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,88% / 15.08.2028	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,91	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 1,63% / 15.05.2026	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,89	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS C	J. Information und Kommunikation	0,84	Vereinigte Staaten von Amerika
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP / 2,15% / 13.02.2030	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,83	Japan
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (NEW YORK BRANCH) / 3,62% / 20.06.2023	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,79	Australien
ING GROEP NV / 4,63% / 06.01.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,78	Niederlande
APPLE INC / 3,00% / 20.06.2027	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,76	Vereinigte Staaten von Amerika
JOHNSON & JOHNSON	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,75	Vereinigte Staaten von Amerika

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

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

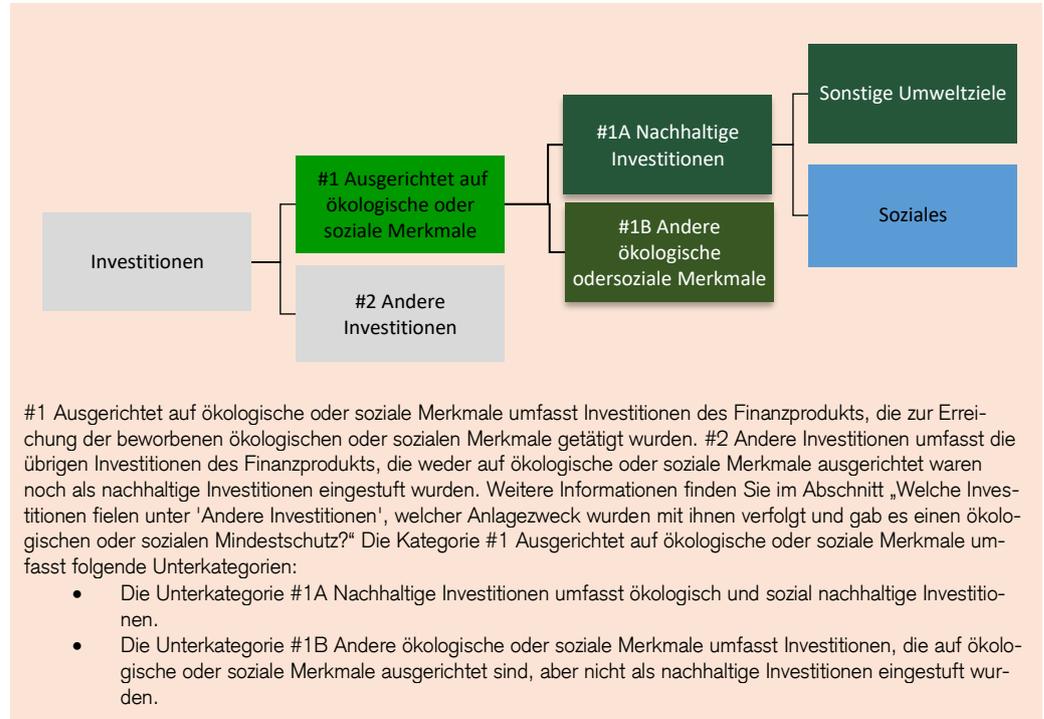
31.03.2023



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Der Anteil der Investitionen, die zur Erfüllung der mit diesem Subfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden (siehe oben Kategorie #1), betrug 91,18% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 24,87% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

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

#### Fondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,04%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,74%
C. Verarbeitendes Gewerbe	25,11%
D. Energieversorgung	2,04%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,20%
F. Baugewerbe	0,64%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,18%
H. Verkehr und Lagerei	2,25%
I. Gastgewerbe	0,45%
J. Information und Kommunikation	13,84%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	25,12%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,56%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,33%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,53%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	15,49%
P. Bildung	0,04%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,55%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,07%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,02%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,90%
Sonstiges	1,91%

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

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,70%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,05%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,30%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,07%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,14%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	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 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup> ?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

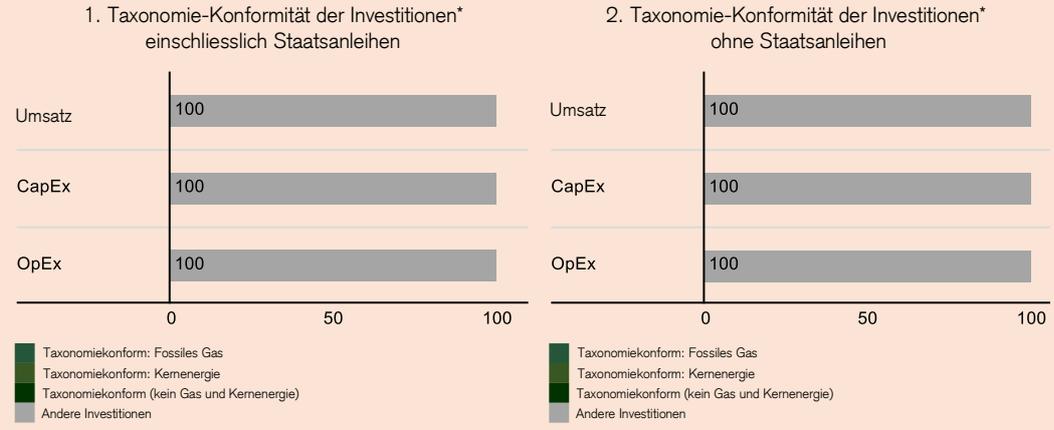
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Zum 31.03.2023 waren 22,38% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 2,49% 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 31.03.2023 waren 8,82% 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 beitragen. Weitere Informationen über das Engagement des Portfolios in diesen Anlagen sind im Abschnitt Finanzen dieses Jahresberichts aufgeführt. Diese Anlagen hatten keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Sie wurden unter Umständen als Instrumente für die effiziente Portfolioverwaltung, für die Liquiditätssteuerung, für Absicherungszwecke oder als zusätzliche Renditequelle eingesetzt.

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

## ANHANG IV

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

**Name des Produkts:** CS (Lux) Portfolio Fund Growth EUR      **Unternehmenskennung (LEI-Code):** 5299001E9001Q0JD7747

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30,24% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 23,07%, AA: 32,07%, A: 25,40%, BBB: 11,13%, BB: 3,05%, B: 0,62%, CCC: 0,06%, Nicht bewertbar**: 1,87%, Keine Datenabdeckung**: 2,73%	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	6,54	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 Unternehmensführung	5,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 40,16%, Gelb: 26,10%, Orange: 19,85%, Rot: 0,10%, Nicht bewertbar**: 11,78%, Keine Datenabdeckung**: 1,23%	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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 7,38%, Neutral: 10,57%, Negativ: 1,26%, Kein Rating: 0,27%, Nicht bewertbar**: 80,53%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

**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?*

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%)**	Datenabdeckung (%)***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	4'065.16	87,93	86,16
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1'179.80	87,93	86,16
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	29'902.49	87,93	86,12
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	35'056.58	87,93	85,86
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	298,48	87,93	85,86
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	725,82	87,93	86,22

4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	8,18	87,93	86,82
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	54,05	87,93	76,20
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	87,93	78,76
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	87,93	78,76
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,19	87,93	78,76
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,07	87,93	78,76
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	87,93	78,76
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	87,93	78,76
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	87,93	78,76
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	87,93	78,76
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	87,93	78,76
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	87,93	86,82
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	251,69	87,93	0,64
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	581,91	87,93	33,13
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,10	87,93	87,05
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)	40,51	87,93	86,66
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,29	87,93	20,56
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (weibliche Mitglieder in Prozent aller Mitglieder)	29,68	87,93	86,51
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	87,93	86,82
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	37,15	9,44	8,50
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	9,44	8,50
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	2,21	9,44	8,50

## Indikatoren für Investitionen in Immobilien Fossile Brennstoffe

17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
--	-------	------	------

## Energieeffizienz

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

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	2,82	Vereinigte Staaten von Amerika
LVMH	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,30	Frankreich
ASML HOLDING NV	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,11	Niederlande
LOREAL SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,38	Frankreich
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,08	Taiwan, Volksrepublik China
ALLIANZ	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,97	Deutschland
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,96	Global
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,95	Vereinigte Staaten von Amerika
SCHNEIDER ELECTRIC	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,91	Frankreich
TESLA INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,81	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	0,79	Vereinigte Staaten von Amerika
LAIR LIQUIDE SOCIETE ANONYME POUR	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,79	Frankreich
TENCENT HOLDINGS LTD	J. Information und Kommunikation	0,77	China
AXA SA	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,77	Frankreich
BNP PARIBAS SA	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,74	Frankreich

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

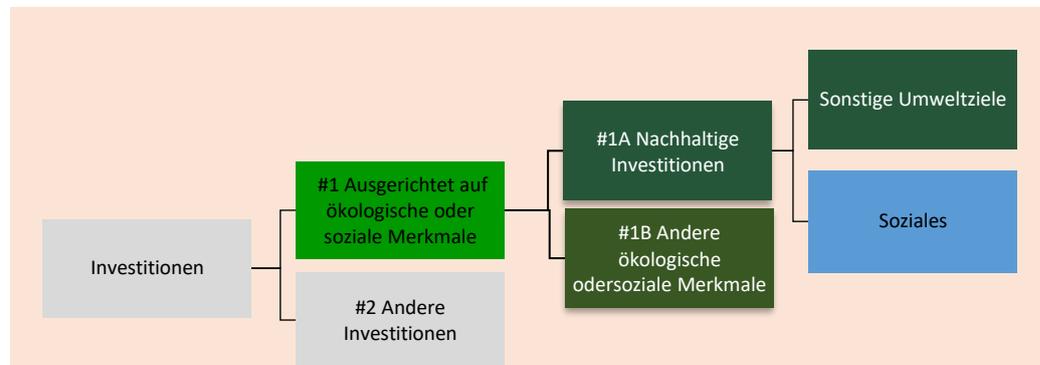
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

31.03.2023



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● *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 folgende Unterkategorien:

- 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 92,16% seines Gesamtvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 30,24% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

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

#### Fondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,04%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,52%
C. Verarbeitendes Gewerbe	35,51%
D. Energieversorgung	2,74%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,23%
F. Baugewerbe	0,91%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,86%
H. Verkehr und Lagerei	2,13%
I. Gastgewerbe	0,50%
J. Information und Kommunikation	13,80%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	20,91%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,42%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,30%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,60%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	8,67%
P. Bildung	0,04%

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

Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,46%
R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,11%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,19%
Sonstiges	2,05%

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

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

### Fondsendagement in 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	0,04%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,25%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	2,25%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,17%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölerzeugnissen	0,10%

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

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



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup> ?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

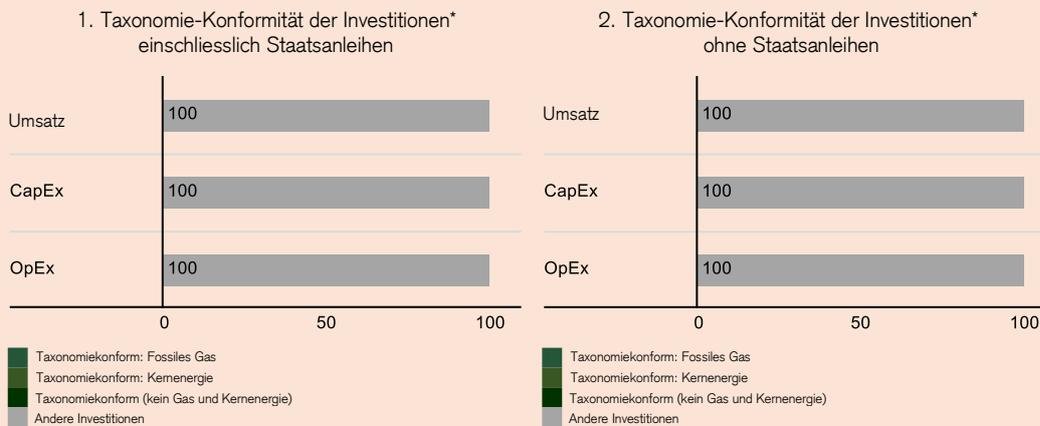
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 27,15% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 3,09% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 7,84% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

## ANHANG IV

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

**Name des Produkts:** CS (Lux) Portfolio Fund Growth CHF      **Unternehmenskennung (LEI-Code):** 529900HON352IXZBV42

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,55% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,92%, AA: 36,83%, A: 26,96%, BBB: 10,31%, BB: 3,59%, B: 0,98%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,89%, Keine Datenabdeckung**: 3,40%,	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	5,30	Portfolio-Gesamtscore der Säule Soziales: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
Score der Säule Unternehmensführung	5,92	Portfolio-Gesamtscore der Säule Unternehmensführung: 1 (Tiefstwert) – 10 (Höchstwert)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 40,34%, Gelb: 23,28%, Orange: 22,65%, Rot: 0,03%, Nicht bewertbar**: 11,12%, 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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 6,42%, Neutral: 11,05%, Negativ: 1,58%, Kein Rating: 0,28%, Nicht bewertbar**: 80,68%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

**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?*

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	5'600.37	88,42	84,69
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1'893.79	88,42	84,69
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	52'886.72	88,42	84,60
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	60'265.53	88,42	84,38
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	232,65	88,42	84,38

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	661,39	88,42	86,13
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	5,00	88,42	86,70
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	54,53	88,42	75,03
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,42	77,44
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	88,42	77,44
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,17	88,42	77,44
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,04	88,42	77,44
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,42	77,44
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,42	77,44
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	88,42	77,44
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	88,42	77,44
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	88,42	77,44
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	88,42	86,70
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	532,24	88,42	0,52
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	1'201,04	88,42	32,22
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,03	88,42	86,86
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)	40,54	88,42	86,36
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,37	88,42	23,81
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	27,57	88,42	86,34
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	88,42	86,70
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	35,60	8,93	7,61
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	8,93	7,61

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	2,01	8,93	7,61
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	4,79	Schweiz
ROCHE HOLDING PAR AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,99	Schweiz
NOVARTIS AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,76	Schweiz
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	2,30	Vereinigte Staaten von Amerika
ZURICH INSURANCE GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,41	Schweiz
ABB LTD	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,40	Schweiz
COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,26	Schweiz
UBS GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,23	Schweiz
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,09	Taiwan, Volksrepublik China
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,99	Global
SIKA AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,90	Schweiz
GIVAUDAN SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,81	Schweiz
TENCENT HOLDINGS LTD	J. Information und Kommunikation	0,78	China
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,78	Vereinigte Staaten von Amerika
LONZA GROUP AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,68	Schweiz

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

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

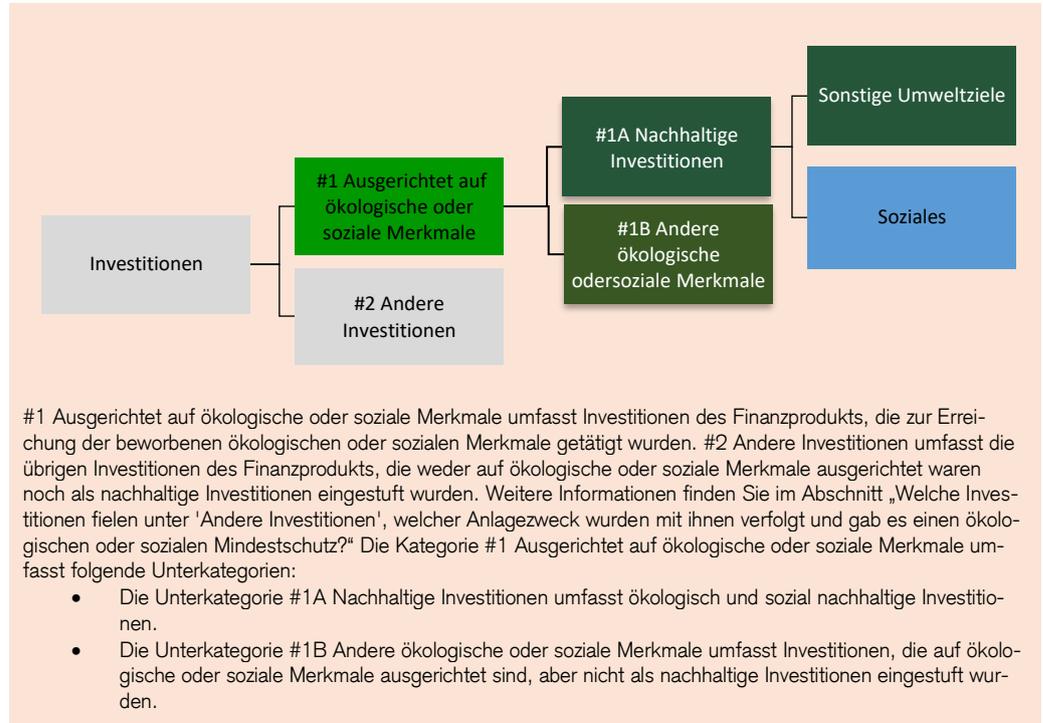
31.03.2023



## 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 92,26% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 24,55% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

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

#### Fondsenagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,04%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,43%
C. Verarbeitendes Gewerbe	40,26%
D. Energieversorgung	1,41%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,20%
F. Baugewerbe	0,71%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,98%
H. Verkehr und Lagerei	1,96%
I. Gastgewerbe	0,42%
J. Information und Kommunikation	11,02%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	22,49%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,34%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,17%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,92%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	7,82%
P. Bildung	0,04%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,38%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,09%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,19%
Sonstiges	2,13%

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

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,53%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,08%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,21%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,03%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,11%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,00%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	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 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup>?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

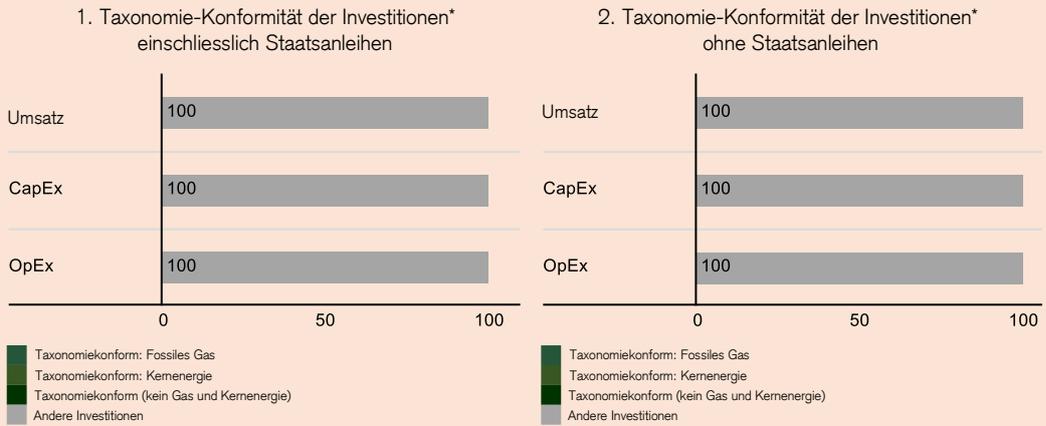
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 22,25% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 2,30% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 7,74% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

## ANHANG IV

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

Name des Produkts: CS (Lux) Portfolio Fund Growth USD Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900HSSABB13G0TV87

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 26,54% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 18,97%, AA: 31,73%, A: 29,19%, BBB: 12,13%, BB: 3,02%, B: 0,50%, CCC: 0,06%, Nicht bewertbar**: 1,93%, Keine Datenabdeckung**: 2,47%	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)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 37,70%, Gelb: 26,12%, Orange: 19,99%, Rot: 0,03%, Nicht bewertbar**: 14,35%, 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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 6,03%, Neutral: 11,88%, Negativ: 1,16%, Kein Rating: 0,27%, Nicht bewertbar**: 80,66%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

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?*

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	4'004.97	85,33	83,39
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1'324.31	85,33	83,39
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	37'460.65	85,33	83,35
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	42'656.52	85,33	83,10
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	262,87	85,33	83,10

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	673,61	85,33	83,82
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	6,83	85,33	84,41
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	51,77	85,33	73,06
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	85,33	76,09
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	85,33	76,09
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,15	85,33	76,09
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,05	85,33	76,09
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	85,33	76,09
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	85,33	76,09
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	85,33	76,09
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	85,33	76,09
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	85,33	76,09
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	85,33	84,41
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	320,90	85,33	0,47
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	775,66	85,33	28,79
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,03	85,33	84,60
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)	46,66	85,33	84,24
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,23	85,33	23,48
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	27,26	85,33	83,74
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	85,33	84,41
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	45,62	11,99	10,69
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	11,99	10,69

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	2,24	11,99	10,69
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	5,10	Vereinigte Staaten von Amerika
NVIDIA CORP	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,72	Vereinigte Staaten von Amerika
TESLA INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,50	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS A	J. Information und Kommunikation	1,36	Vereinigte Staaten von Amerika
ALPHABET INC CLASS C	J. Information und Kommunikation	1,26	Vereinigte Staaten von Amerika
JOHNSON & JOHNSON	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,21	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED PARCEL SERVICE INC CLASS B	H. Verkehr und Lagerei	1,20	Vereinigte Staaten von Amerika
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,10	Taiwan, Volksrepublik China
CATERPILLAR INC	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,03	Vereinigte Staaten von Amerika
S&P GLOBAL INC	J. Information und Kommunikation	1,02	Vereinigte Staaten von Amerika
MORGAN STANLEY	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,96	Vereinigte Staaten von Amerika
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,93	Global
PROCTER & GAMBLE	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,92	Vereinigte Staaten von Amerika
AMERICAN EXPRESS	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,89	Vereinigte Staaten von Amerika
ELI LILLY	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,89	Vereinigte Staaten von Amerika

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

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

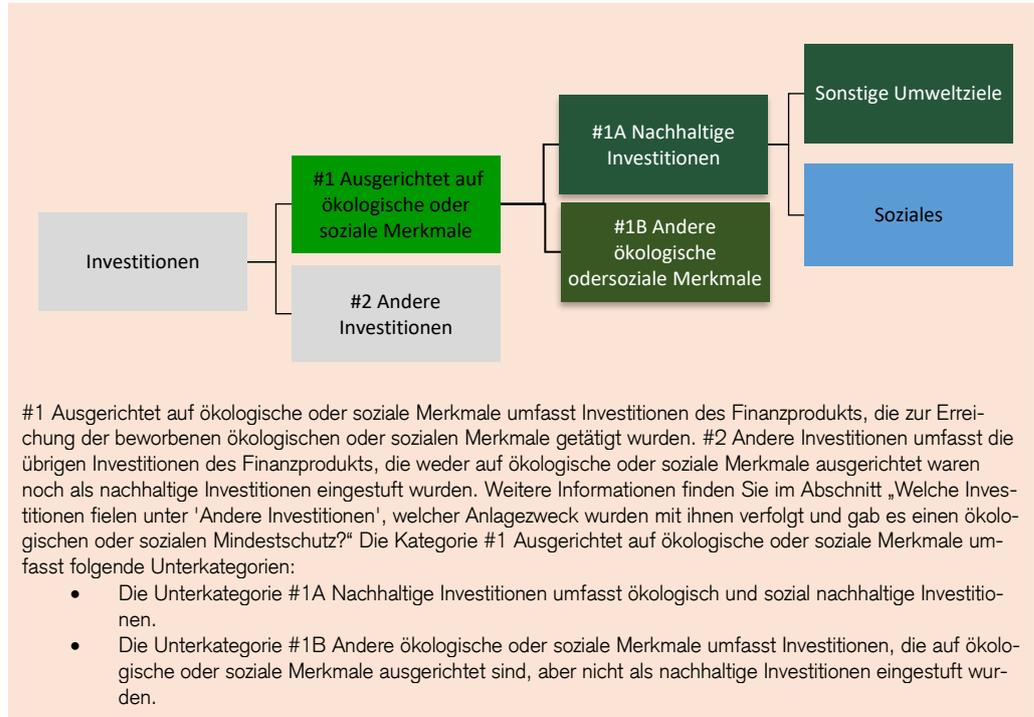
31.03.2023



## 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 92,14% seines Gesamtvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 26,54% seines Gesamtvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

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

#### Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,76%
C. Verarbeitendes Gewerbe	30,98%
D. Energieversorgung	2,23%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,19%
F. Baugewerbe	0,85%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,18%
H. Verkehr und Lagerei	2,72%
I. Gastgewerbe	0,50%
J. Information und Kommunikation	16,91%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	18,67%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,79%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,48%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,60%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	10,82%
P. Bildung	0,05%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,49%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,10%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,02%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,54%
Sonstiges	2,11%

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

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,50%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,04%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,50%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,36%
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 Mineralölzerzeugnissen	0,11%

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

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



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup> ?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

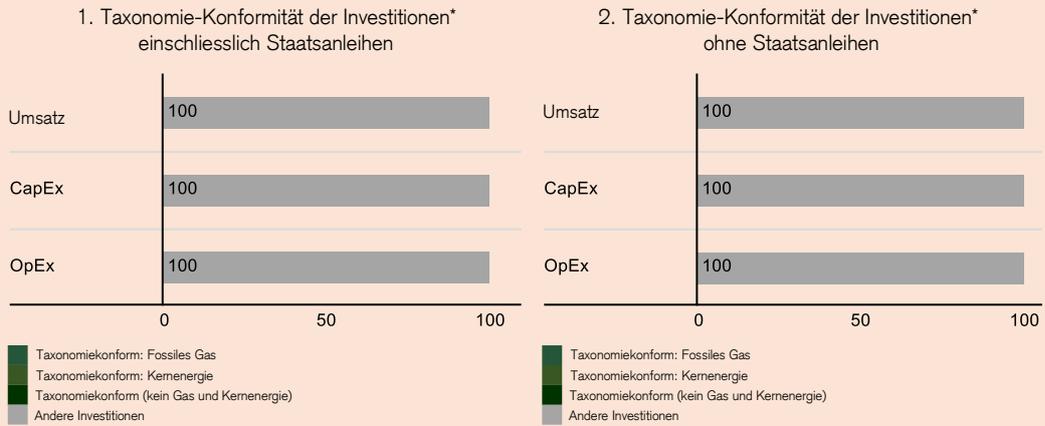
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 23,45% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 3,09% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 7,86% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

ANHANG IV

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

**Name des Produkts:** CS (Lux) Portfolio Fund Yield EUR **Unternehmenskennung (LEI-Code):** 529900RAL1DIYKWCES60

**Ökologische und/oder soziale Merkmale**

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

●● <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	●● <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30,64% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 15,15%, AA: 27,49%, A: 28,30%, BBB: 16,28%, BB: 4,32%, B: 0,81%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,67%, Keine Datenabdeckung**: 5,87%	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)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 28,30%, Gelb: 21,39%, Orange: 15,89%, Rot: 0,15%, Nicht bewertbar**: 30,86%, 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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 23,26%, Neutral: 34,47%, Negativ: 3,63%, Kein Rating: 0,51%, Nicht bewertbar**: 38,13%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

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?*

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

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	11'861.04	67,23	61,91
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	3'074.62	67,23	61,91
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	85'056.58	67,23	61,86
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	99'861.47	67,23	61,74
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	235,09	67,23	61,74

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	539,00	67,23	64,16
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	7,44	67,23	65,11
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	38,86	67,23	58,70
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	67,23	60,06
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	67,23	60,06
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,10	67,23	60,06
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,06	67,23	60,06
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	67,23	60,06
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	67,23	60,06
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	67,23	60,06
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	67,23	60,06
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	67,23	60,06
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	67,23	65,11
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	1'442,39	67,23	0,48
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	4'593,27	67,23	25,25
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,16	67,23	65,25
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)	26,97	67,23	64,99
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,11	67,23	16,92
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	21,92	67,23	63,75
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	67,23	65,11
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	101,66	30,27	25,48
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	30,27	25,48

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	2,16	30,27	25,48
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,96	Global
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	1,13	Vereinigte Staaten von Amerika
COOPERATIEVE RABOBANK UA / 0,25% / 30.10.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,12	Niederlande
EDP FINANCE BV / 1,88% / 13.10.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,10	Portugal
ING GROEP NV / 2,50% / 15.11.2030	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,04	Niederlande
SPANIEN (KÖNIGREICH) / 1,60% / 30.04.2025	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,04	Spanien
SPANIEN (KÖNIGREICH) / 2,75% / 31.10.2024	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,96	Spanien
LVMH	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,93	Frankreich
GERMANY (BUNDESREPUBLIK) / 1,50% / 15.05.2023	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,92	Deutschland
E.ON SE / 0,88% / 20.08.2031	D. Energieversorgung	0,92	Deutschland
KFW / 2,75% / 14.02.2033	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,91	Deutschland
PORTUGAL (REPUBLIK) / 1,95% / 15.06.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,89	Portugal
BNP PARIBAS SA / 1,13% / 28.08.2024	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,88	Frankreich
ASML HOLDING NV	C. Verarbeitendes Gewerbe	0,87	Niederlande
KFW / 1,75% / 14.09.2029	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,84	Deutschland

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

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

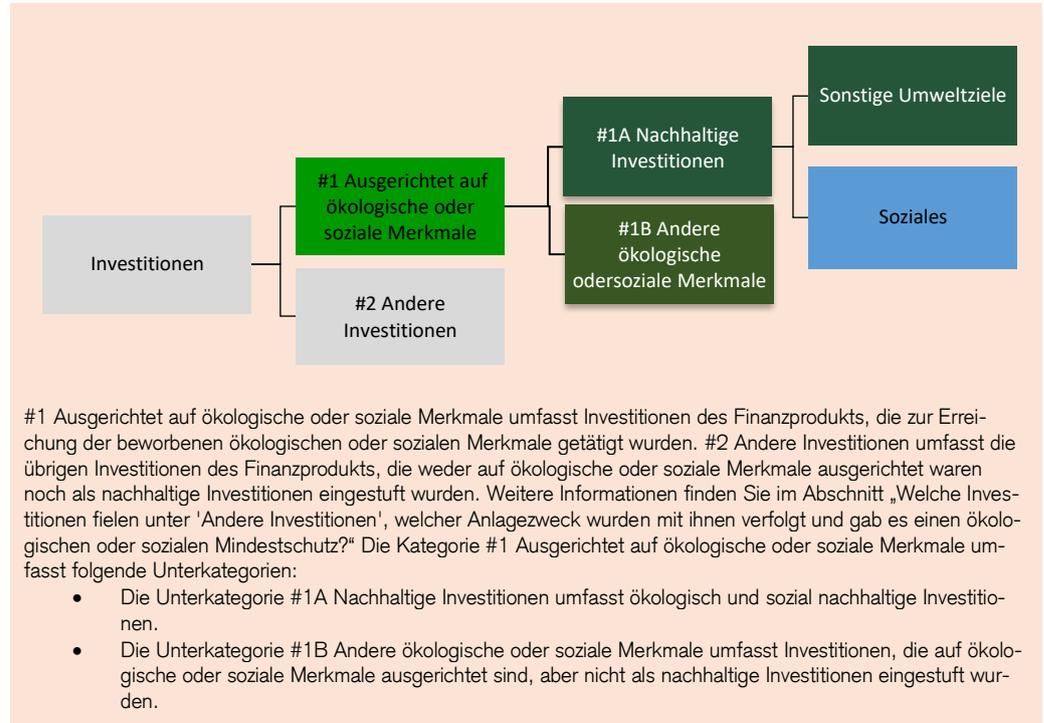
31.03.2023



## 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 90,10% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 30,64% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

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

#### Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,02%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,34%
C. Verarbeitendes Gewerbe	18,42%
D. Energieversorgung	3,34%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,12%
F. Baugewerbe	0,48%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,37%
H. Verkehr und Lagerei	1,83%
I. Gastgewerbe	0,25%
J. Information und Kommunikation	7,50%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	32,52%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	2,82%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,74%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,33%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	25,01%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,26%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,04%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,60%
Sonstiges	1,94%

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

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,65%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,06%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,10%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	1,14%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,14%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	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 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup> ?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

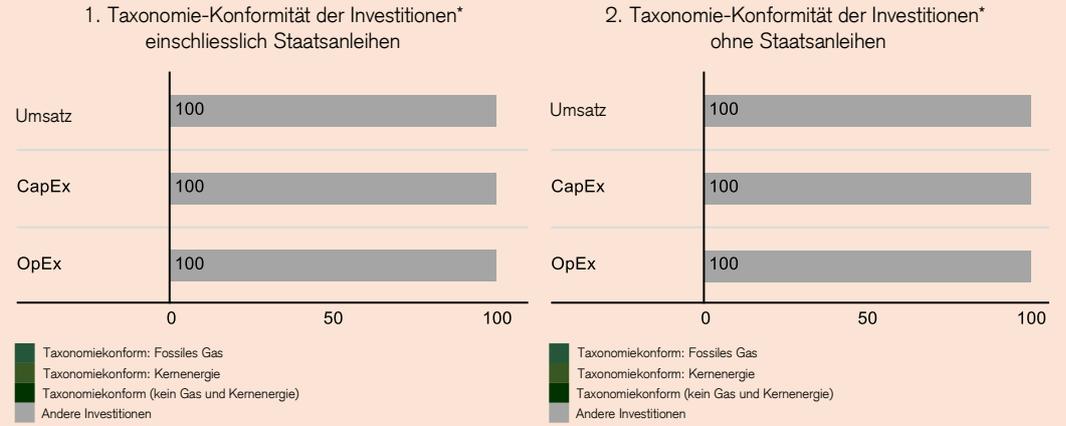
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 28,96% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 1,67% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 9,90% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

## ANHANG IV

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

**Name des Produkts:** CS (Lux) Portfolio Fund Yield  
CHF

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 5299004MFUN5FVOXWP48

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<span style="color: green;">●●</span> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<span style="color: green;">●</span> <span style="color: white;">●</span> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 23,08% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 12,11%, AA: 31,35%, A: 28,60%, BBB: 11,57%, BB: 5,85%, B: 1,14%, CCC: 0,13%, Nicht bewertbar**: 1,74%, Keine Datenabdeckung**: 7,52%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	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)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 34,51%, Gelb: 18,55%, Orange: 19,05%, Rot: 0,07%, Nicht bewertbar**: 23,50%, Keine Datenabdeckung**: 3,63%	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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 24,27%, Neutral: 32,57%, Negativ: 4,00%, Kein Rating: 1,13%, Nicht bewertbar**: 38,03%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

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?

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	16'878.05	78,04	64,60
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	4'310.48	78,04	64,60
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	145'448.44	78,04	64,52
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	166'489.74	78,04	64,40
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	201,13	78,04	64,40

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	581,02	78,04	72,15
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	5,13	78,04	74,13
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	45,11	78,04	63,02
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	78,04	64,68
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	78,04	64,68
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,09	78,04	64,68
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,04	78,04	64,68
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	78,04	64,68
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	78,04	64,68
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	78,04	64,68
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	78,04	64,68
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	78,04	64,68
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	78,04	74,13
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	3'076.93	78,04	0,38
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	9'871.53	78,04	20,93
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,07	78,04	74,23
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)	32,58	78,04	73,93
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	1,92	78,04	15,19
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	23,32	78,04	71,09
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	78,04	74,13
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	73,10	19,40	14,35
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	19,40	14,35

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	1,95	19,40	14,35
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,02	Global
NESTLE SA	C. Verarbeitendes Gewerbe	2,05	Schweiz
ROCHE HOLDING PAR AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,29	Schweiz
MUENCHENER HYPOTHEKENBK EG / 0,25% / 18.09.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,27	Deutschland
NOVARTIS AG	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,17	Schweiz
FIRST ABU DHABI BANK PJSC / 0,07% / 31.03.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,13	Vereinigte Arabische Emirate
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	0,98	Vereinigte Staaten von Amerika
MUENCHENER HYPOTHEKENBK EG / 0,10% / 17.12.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,88	Deutschland
BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT UND OESTERREICHISCHE P / 2,96% / 29.11.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,87	Österreich
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD / 0,13% / 21.06.2027	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,80	Australien
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK / 0,20% / 28.11.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,73	Supranational
UNITED STATES TREASURY / 2,38% / 15.05.2029	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,71	Vereinigte Staaten von Amerika
ABN AMRO BANK NV / 2,63% / 02.03.2028	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,64	Niederlande
CENTRAL AMERICAN BANK / 0,11% / 15.12.2028		0,61	Lateinamerika, supranational
ZURICH INSURANCE GROUP AG	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,61	Schweiz

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

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

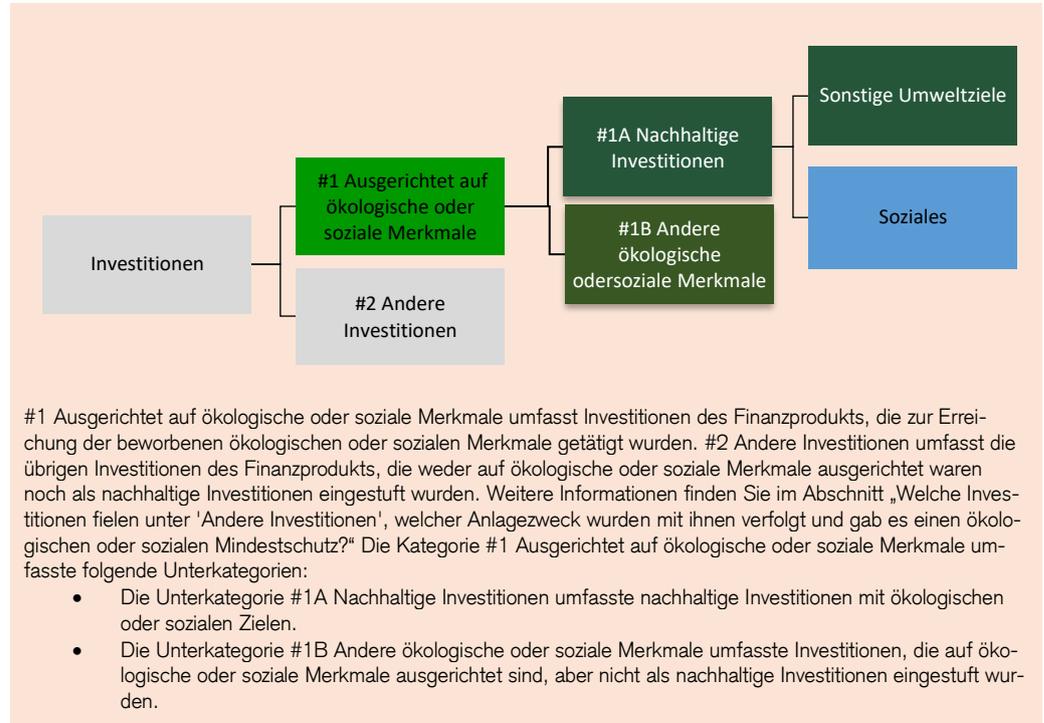
31.03.2023



## 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 89,56% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 23,08% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

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

#### Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,02%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,40%
C. Verarbeitendes Gewerbe	19,71%
D. Energieversorgung	1,52%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,10%
F. Baugewerbe	0,36%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,08%
H. Verkehr und Lagerei	1,44%
I. Gastgewerbe	0,22%
J. Information und Kommunikation	6,23%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	43,40%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,02%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,69%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,67%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	15,43%
P. Bildung	0,02%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,25%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,03%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,72%
Sonstiges	2,67%

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,63%
B6.2.0	Gewinnung von Erdgas	0,13%
B9.1.0	Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,09%
C19.2.0	Mineralölverarbeitung	0,64%
D35.2.1	Gaserzeugung	0,00%
D35.2.2	Gasverteilung durch Rohrleitungen	0,09%
D35.2.3	Gashandel durch Rohrleitungen	0,01%
G46.7.1	Großhandel mit festen Brennstoffen und Mineralölzerzeugnissen	0,06%

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

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



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup>?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

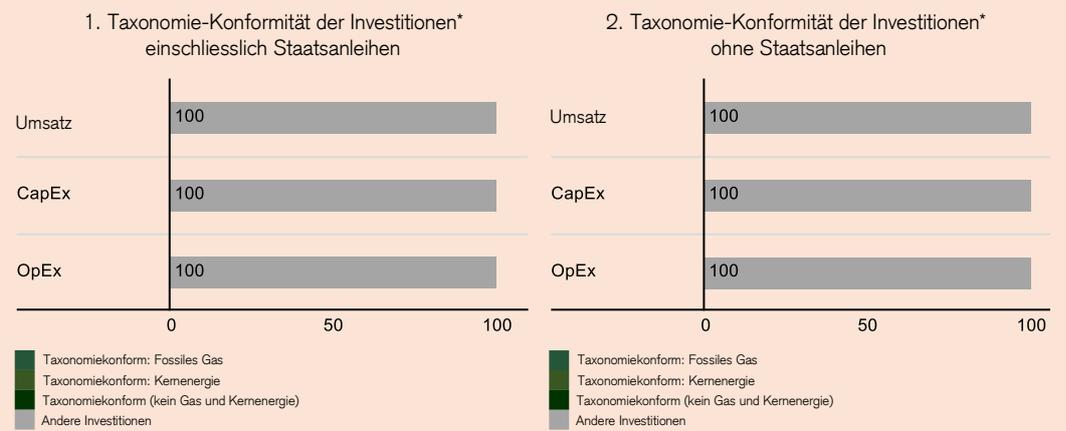
Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und den Umstieg auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Brennstoffe bis Ende 2035. Für die **Kernenergie** umfassen die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige "Umweltfreundlichkeit" der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln  
 - **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 21,79% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 1,29% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 10,44% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

## ANHANG IV

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

Name des Produkts: CS (Lux) Portfolio Fund Yield USD

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900ZNI5E2QV31N773

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <b>Ja</b>	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> _____% getätigt: <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input checked="" type="checkbox"/> <b>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 23,92% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen</b> getätigt.

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

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



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

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

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

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

- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 5% ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen und Schusswaffen, Tabakerzeugnissen, Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Nicht investieren in Unternehmen, die mehr als 20% ihres Umsatzes mit dem Handel mit Tabakerzeugnissen und mit Hilfssystemen für konventionelle Waffen oder mit Kohle (d. h. Kohlebergbau und Stromerzeugung aus Kohle) erzielen (wertebasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- Einhalten internationaler Normen wie die Prinzipien des "United Nations Global Compact" (UNGC) und Betreiben der Geschäftstätigkeit in Einklang mit ihnen (verhaltensbasierte Ausschlüsse bei direkten Investitionen)
- 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
- 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
- Beitrag zu guter Unternehmensführung und nachhaltigen Praktiken durch Stimmrechtsvertretung und Engagement bei den Unternehmen, in die investiert wird, im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren der Credit Suisse Asset Management (Aktives Aktionärstum)

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

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

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

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

Nachhaltigkeitsindikator*	Portfolio	Indikatorleistung
ESG-Rating	AAA: 12,66%, AA: 25,26%, A: 36,71%, BBB: 13,13%, BB: 4,87%, B: 0,77%, CCC: 0,11%, Nicht bewertbar**: 1,10%, Keine Datenabdeckung**: 5,39%	Anlagenexposure nach ESG-Rating: AAA (Höchstwert): 0–100% AA: 0–100% A: 0–100% BBB: 0–100% BB: 0–100% B: 0–100% CCC (Tiefstwert): 0–100%
Score der Säule Umwelt	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)
ESG-Klassifizierung von 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: Wirkung: 0-100% Nachhaltiges Thema: 0-100% ESG-bewusst: 0-100% Beeinträchtigung vermeiden: 0-100% Traditionell: 0-100% Nicht nachhaltig: 0-100%
Warnsignal ESG-Kontroversen	Grün: 26,48%, Gelb: 19,50%, Orange: 20,29%, Rot: 0,07%, Nicht bewertbar**: 30,87%, Keine Datenabdeckung**: 2,10%	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.	Dieser Indikator bildet ab, dass das Portfolio die anwendbaren ESG-Ausschlüsse erfüllt, die auf der Website unter "Ausschlüsse" beschrieben werden.

	Erkannte Verstöße werden gemeldet und behoben.	
Eigenes ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen	Positiv: 19,45%, Neutral: 38,85%, Negativ: 3,60%, Kein Rating: 0,51%, Nicht bewertbar**: 37,60%	Portfolioexposition nach eigenem ESG-Warnsignal für festverzinsliche Anlagen Positiv: 0–100% Neutral: 0–100% Negativ: 0–100%

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

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

\*\*\* Beachten Sie, dass der Umfang der Investitionen, die aufgrund der ESG-Ausschlüsse beschränkt wurden, vom Anlageuniversum des Fonds und dem jeweiligen Engagement des Fonds in bestimmten Sektoren und Märkten abhängt.

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

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

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

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

- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem ökologischen Ziel (z. B. alternative Energie, CO<sub>2</sub>- und Energieeffizienz, grüne Gebäude, nachhaltige Wasserbewirtschaftung, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Landwirtschaft usw.) beitrugen.
- Investitionen in Unternehmen, die mindestens 50% ihrer Umsätze aus Produkten und Dienstleistungen erzielten, die zu einem sozialen Ziel (z. B. Ernährung, Behandlung von Krankheiten, Sanitärversorgung, erschwingliche Immobilien, KMU-Finanzierung, Bildung, Vernetzung usw.) beitrugen.
- Investitionen, die eine bestätigte Verpflichtung zu wissenschaftsbasierten Emissionszielen und eine durchschnittliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von 7% über die letzten drei Jahre haben.
- Investitionen in Wertpapiere, deren Erlöse ein vordefiniertes ökologisches oder soziales Ziel verfolgen (z. B. grüne Anleihen).

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

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

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

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?

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

Investitionen dürfen:

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

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

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

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



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

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

Nachhaltigkeitsindikator/Messgröße für nachteilige Auswirkungen	Wirkung *	Infrage kommende Vermögenswerte (%) **	Datenabdeckung (%) ***
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN</b>			
<b>Treibhausgasemissionen</b>			
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	5'958.96	71,09	65,33
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	1'594.23	71,09	65,33
1. Scope-3-Treibhausgasemissionen (in Tonnen)	49'898.16	71,09	65,23
1. Treibhausgasemissionen insgesamt (in Tonnen)	57'316.39	71,09	65,08
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro investierte Million EUR)	225,20	71,09	65,08

3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR Umsatz)	610,98	71,09	67,80
4. Engagement in Unternehmen, die im Sektor fossile Brennstoffe tätig sind (in Prozent)	6,20	71,09	69,29
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (in Prozent)	40,26	71,09	60,77
6.A. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE A (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	71,09	62,04
6.B. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE B (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	71,09	62,04
6.C. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE C (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,09	71,09	62,04
6.D. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE D (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,06	71,09	62,04
6.E. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE E (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	71,09	62,04
6.F. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE F (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	71,09	62,04
6.G. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE G (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,00	71,09	62,04
6.H. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE H (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,02	71,09	62,04
6.L. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE L (in GWh pro Million EUR Umsatz) ****	0,01	71,09	62,04
<b>Biodiversität</b>			
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (in Prozent)	0,00	71,09	69,29
<b>Wasser</b>			
8. Emissionen in Wasser (in Tonnen)	949,57	71,09	0,43
<b>Abfall</b>			
9. Anteil gefährlicher Abfälle (in Tonnen)	2'989,37	71,09	21,85
<b>SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
<b>Soziales und Beschäftigung</b>			
10. Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	0,08	71,09	69,50
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (in Prozent)	38,04	71,09	69,09
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (in Prozent des männlichen Bruttoverdienstes)	2,33	71,09	16,21
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (in Prozent der weiblichen Mitglieder)	21,24	71,09	66,12
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (in Prozent)	0,00	71,09	69,29
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
<b>Umwelt</b>			
15. THG-Emissionsintensität (Scope 1, 2 und 3 in Tonnen pro Million EUR des BIP)	102,83	27,02	24,17
<b>Soziales</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolut)	3,00	27,02	24,17

16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (relativ)	2,21	27,02	24,17
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>			
<b>Fossile Brennstoffe</b>			
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00
<b>Energieeffizienz</b>			
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz (in Prozent)	k. A.	0,00	0,00

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

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen *	NACE-Sektorcode	In % der Vermögenswerte	Land
CS LUX HIGH YIELD BF MB USD	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,93	Global
MICROSOFT CORP	J. Information und Kommunikation	2,10	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 4,50% / 15.02.2036	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,95	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,13% / 29.02.2024	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,54	Vereinigte Staaten von Amerika
ING GROEP NV / 4,63% / 06.01.2026	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,39	Niederlande
APPLE INC / 3,00% / 20.06.2027	C. Verarbeitendes Gewerbe	1,36	Vereinigte Staaten von Amerika
KOMMUNALBANKEN AS / 2,13% / 11.02.2025	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,33	Norwegen
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (NEW YORK BRANCH) / 3,62% / 20.06.2023	K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,23	Australien
VERIZON COMMUNICATIONS INC / 3,88% / 08.02.2029	J. Information und Kommunikation	1,19	Vereinigte Staaten von Amerika
AVANGRID INC / 3,80% / 01.06.2029	D. Energieversorgung	1,16	Spanien
UNITED STATES TREASURY / 1,88% / 31.07.2026	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,15	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 0,63% / 15.08.2030	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,14	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,00% / 15.02.2025	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	1,01	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 2,25% / 15.11.2027	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,99	Vereinigte Staaten von Amerika
UNITED STATES TREASURY / 1,63% / 15.05.2026	O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	0,99	Vereinigte Staaten von Amerika

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

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

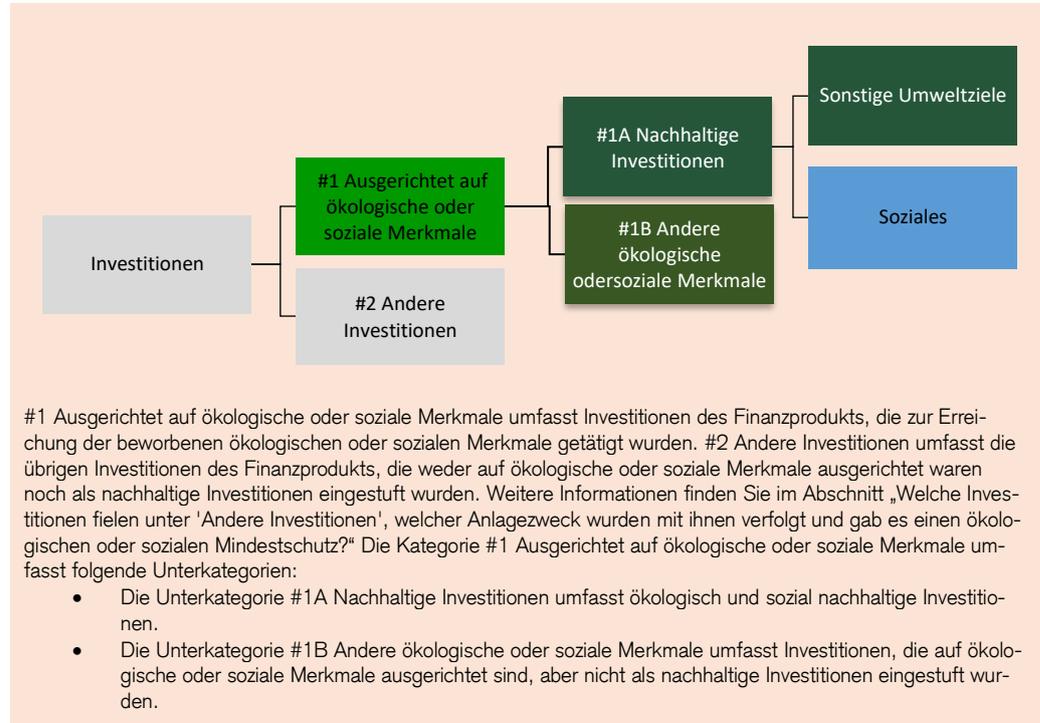
31.03.2023



## 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 90,83% seines Gesamtnettvermögens. In dieser Kategorie hielt der Subfonds einen Anteil von 23,92% seines Gesamtnettvermögens in nachhaltigen Investitionen (siehe oben Kategorie #1A). Diese Daten zeigen den Stand zum 31.03.2023. Sie stellen keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und sind für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für die Vermögensallokation.

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

#### Fondsengagement nach Sektoren

NACE-Sektorcode *	Portfolioengagement **
A. Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,03%
B. Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,61%
C. Verarbeitendes Gewerbe	18,88%
D. Energieversorgung	2,28%
E. Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,13%
F. Baugewerbe	0,41%
G. Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,00%
H. Verkehr und Lagerei	2,02%
I. Gastgewerbe	0,31%
J. Information und Kommunikation	10,25%
K. Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	29,48%
L. Grundstücks- und Wohnungswesen	3,08%
M. Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,97%
N. Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,31%
O. Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	23,53%
P. Bildung	0,03%
Q. Gesundheits- und Sozialwesen	0,42%

R. Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,03%
S. Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01%
U. Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,85%
Sonstiges	1,36%

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

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

### Fondsengagement in Teilssektoren der fossilen Brennstoffe

NACE-Sektorcode *	NACE-Name	Portfolioengagement **
B5.1.0	Steinkohlenbergbau	0,00%
B5.2.0	Braunkohlenbergbau	0,00%
B6.1.0	Gewinnung von Erdöl	0,74%
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	0,83%
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 Mineralölzerzeugnissen	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 31.03.2023. Dies stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Engagement des Portfolios.



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

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

#### ● Hat das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und/oder Kernenergie investiert, die mit der EU-Taxonomie konform sind<sup>1</sup> ?

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

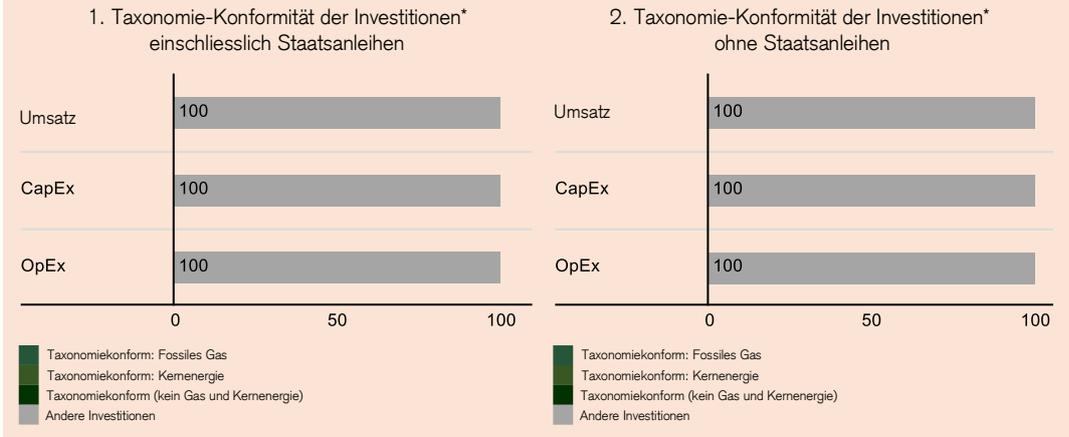
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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



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

Zum 31.03.2023 waren 22,12% der Anlagen des Subfonds in nachhaltige Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel geflossen.

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



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum 31.03.2023 waren 1,80% der Anlagen des Subfonds in sozial nachhaltige Investitionen geflossen.



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

Zum 31.03.2023 waren 9,17% der Anlagen des Subfonds in "Andere Investitionen" geflossen.

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

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



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

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

- Normenbasierte Ausschlüsse

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

- Wertebasierte Ausschlüsse

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



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

- Verhaltensbasierte Ausschlüsse

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

- Feststellung wesentlicher ESG-Faktoren

Der Anlageverwalter hat die ESG-Faktoren, die für die jeweilige Multi-Asset-Anlagestrategie relevant sind, anhand von Wesentlichkeitsrahmen identifiziert. Wesentlichkeitsrahmen sind Konzepte, die bei der Feststellung nachhaltigkeitsbezogener Probleme und Chancen helfen, welche die Finanzlage oder die betriebliche Leistung potenzieller Unternehmen, in die in einer Branche investiert wird, betreffen dürften. Die Wesentlichkeit der in den Anlageprozess einbezogenen ESG-Faktoren kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- ESG-Wertpapieranalyse

Für Direktinvestitionen, die auf den identifizierten wesentlichen ESG-Faktoren basieren, nutzten die Anlageverwalter die ESG-Ratings von Drittanbietern und kombinierten sie mit den eigenen Analysen und Informationen der CSAM. Dazu gehörten z.B. ESG-bezogene Nachrichten, ESG-Ratings und -Bewertungen, ESG-bezogene Kontroversen und ESG-Trends.

- Wertpapierauswahl und Portfolioimplementierung

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.

- Portfolioüberwachung

Die Anlageverwalter überwachen die ESG-Faktoren regelmäßig, um signifikante Änderungen der ESG-Faktoren der zugrunde liegenden Wertpapiere zu erkennen. Sie bewerteten das Portfolio regelmäßig neu, wobei sie finanzielle und ESG-Kennzahlen berücksichtigten, und entschieden daraufhin, ob sie Positionen im Portfolio auf- oder abbauen.

- Mitwirkung

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

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

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

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

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

Keine Angaben

#### **MSCI-Haftungsausschluss**

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

#### **JESG-Haftungsausschluss**

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

#### **NACE-Quelle**

Eurostat

#### **ESG-Erläuterungen**

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



CREDIT SUISSE FUND MANAGEMENT S.A.  
5, rue Jean Monnet  
L-2180 Luxembourg  
[www.credit-suisse.com](http://www.credit-suisse.com)