

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年12月4日

【発行者名】 クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイ
(Credit Suisse Fund Management S.A.)

【代表者の役職氏名】 取締役 ルドルフ・コーメン
(Rudolf Kömen, Director)
取締役 ダニエル・シエプマン
(Daniel Siepmann, Director)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国 ルクセンブルグ L-2180、ジャン・モネ通り5番
(5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 竹野康造
弁護士 廣本文晴

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 竹野康造
弁護士 廣本文晴
弁護士 坂東慶一
弁護士 星千奈津

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 CSインベストメント・ファンズ・12
- クレディ・スイス(Lux)ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD
- クレディ・スイス(Lux)ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD
- クレディ・スイス(Lux)ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD
(CS Investment Funds 12
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Yield USD
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Balanced USD
- Credit Suisse (Lux) Portfolio Fund Growth USD)

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】 無記名式無額面受益証券
上限見込額は以下のとおりである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イー
ルド・USD

クラスB米ドル（acc）受益証券 1,000,000,000米ドル
（113,570,000,000円）を上限とする。

クラスBH円建て（acc）受益証券 100,000,000,000円を
上限とする。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バラ
ンス・USD

クラスB米ドル（acc）受益証券 1,000,000,000米ドル
（113,570,000,000円）を上限とする。

クラスBH円建て（acc）受益証券 100,000,000,000円を
上限とする。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グ
ロース・USD

クラスB米ドル（acc）受益証券 1,000,000,000米ドル
（113,570,000,000円）を上限とする。

クラスBH円建て（acc）受益証券 100,000,000,000円を
上限とする。

（注）米ドルの円貨換算は、便宜上、2018年9月28日現在の
株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル
= 113.57円）による。以下同じ。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成30年11月22日をもって提出した有価証券届出書の記載事項について、「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況、1 ファンドの性格、（5）開示制度の概要」の記載、「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況、2 投資方針、（1）投資方針」の記載、「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況、4 手数料等及び税金、（3）管理報酬等」の記載、「第二部 ファンド情報、第2 管理及び運営、2 買戻し手続等、（2）日本における買戻し手続等」の記載、「第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」の記載および有価証券届出書添付の監査報告書の記載を修正し、また、有価証券届出書添付の管理会社取締役会議事録の訳文および法律意見書の原本を差し替えるため、本訂正届出書を提出する。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

（5）開示制度の概要

<訂正前>

ルクセンブルグにおける開示

（イ）金融監督委員会に対する開示

ルクセンブルグ内において、またはルクセンブルグから受益証券をルクセンブルグ内外の公衆に対し公募する場合は、C S S Fへの登録およびその承認が要求される。この場合、目論見書、説明書、年次報告書および半期報告書をC S S Fに提出しなければならない。なお、以下本書では、サブ・ファンドに関してC S S Fに提出された目論見書を「**英文目論見書**」といい、本サブ・ファンドに関して日本で作成された目論見書を次項で定義するとおり単に目論見書という。

ファンドの年次報告書に含まれている会計情報は、承認された法定監査人により監査され、C S S Fにより承認されなければならない。ファンドの承認された法定監査人は、プライスウォーターハウス・ソシエテコーペラティブ(PricewaterhouseCoopers, Société Coopérative)である。更に、ファンドは、金融庁（現C S S F）の1997年6月13日付通達97 / 136（C S S F通達08 / 348により改訂済）に基づき、C S S Fに対して月次報告書を提出することを要求されている。

（略）

<訂正後>

ルクセンブルグにおける開示

（イ）金融監督委員会に対する開示

ルクセンブルグ内において、またはルクセンブルグから受益証券をルクセンブルグ内外の公衆に対し公募する場合は、C S S Fへの登録およびその承認が要求される。この場合、目論見書、説明書、年次報告書および半期報告書をC S S Fに提出しなければならない。なお、以下本書では、サブ・ファンドに関してC S S Fに提出された目論見書を「**英文目論見書**」といい、本サブ・ファンドに関して日本で作成された目論見書を次項で定義するとおり単に目論見書という。

ファンドの年次報告書に含まれている会計情報は、承認された法定監査人により監査され、C S S Fにより承認されなければならない。ファンドの承認された法定監査人は、プライスウォーターハウスクーパー・ソシエテ・コーペラティブ(PricewaterhouseCoopers, Société coopérative)

である。更に、ファンドは、金融庁（現ＣＳＳＦ）の1997年6月13日付通達97/136（ＣＳＳＦ通達08/348により改訂済）に基づき、ＣＳＳＦに対して月次報告書を提出することを要求されている。

（略）

2 投資方針

（１） 投資方針

<訂正前>

（略）

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

（略）

投資目的

サブ・ファンドの目的は、リスク分散の原則に従い以下に記載される資産クラスに投資することにより、各参照通貨による投資額に見合うだけのリターンを上げることである。

投資方針

サブ・ファンドは、その資産を世界的規模（新興国を含む。）で投資し、以下に記載される資産クラスに対する直接的または間接的なエクスポージャーをもたらす。間接的なエクスポージャーは、とりわけ、デリバティブ、仕組商品および投資対象ファンドの利用を通じて達成することができる。投資の主要部分は、時に、サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で行われることがある。したがって、為替レートの変動に伴うリスクは、長期的に最小限に抑えられる。

資産配分

（略）

資産クラス	範囲
現金およびその他現金等価物	0% — 50%
<u>確定利付証券</u>	35% — 85%
株式	15% — 35%
オルタナティブ投資	0% — 20%

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

（略）

資産配分

（略）

資産クラス	範囲
現金およびその他現金等価物	0% — 60%
<u>確定利付証券</u>	10% — 70%
株式	30% — 60%
オルタナティブ投資	0% — 20%

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

（略）

資産配分

（略）

資産クラス	範囲
現金およびその他現金等価物	0% — 50%
確定利付証券	0% — 50%
株式	50% — 80%
オルタナティブ投資	0% — 20%

(略)

<訂正後>

(略)

クレディ・スイス(Lux)ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

(略)

投資目的

サブ・ファンドの目的は、リスク分散の原則に従い以下に記載される資産クラスに投資することにより、各参照通貨による投資額に見合うだけのリターンを上げることである。

(注) 参照通貨とは、各サブ・ファンドの名称に含まれる通貨をいい、各サブ・ファンドのパフォーマンスおよび純資産額は、当該参照通貨により計算される。以下同じ。

投資方針

サブ・ファンドは、その資産を世界的規模（新興国を含む。）で投資し、以下に記載される資産クラスに対する直接的または間接的なエクスポージャーをもたらす。間接的なエクスポージャーは、とりわけ、デリバティブ、仕組商品および投資対象ファンドの利用を通じて達成することができる。投資の主要部分は、サブ・ファンドの参照通貨で行われる。したがって、為替レートの変動に伴うリスクは、長期的に最小限に抑えられる。

資産配分

(略)

資産クラス	範囲
現金およびその他現金等価物	0% — 50%
債券	35% — 85%
株式	15% — 35%
オルタナティブ投資	0% — 20%

クレディ・スイス(Lux)ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

(略)

資産配分

(略)

資産クラス	範囲
現金およびその他現金等価物	0% — 60%
債券	10% — 70%
株式	30% — 60%
オルタナティブ投資	0% — 20%

クレディ・スイス(Lux)ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

(略)

資産配分

(略)

資産クラス	範囲
現金およびその他現金等価物	0% — 50%
債券	0% — 50%
株式	50% — 80%
オルタナティブ投資	0% — 20%

(略)

4 手数料等及び税金**(3) 管理報酬等**

<訂正前>

(略)

管理報酬

管理報酬は、サブ・ファンドの信託財産の管理業務の対価として管理会社に支払われる。

各月の末日に、当該月中の関連する受益証券クラスの平均日次純資産価額に基づき支払うべき管理会社に月間管理報酬が支払われる。かかる管理報酬は、個別のサブ・ファンドおよびサブ・ファンドの受益証券クラスごとに異なる率で請求される場合があり、または全額放棄される場合がある。

(略)

<訂正後>

(略)

管理報酬

管理報酬は、サブ・ファンドの信託財産の管理業務の対価として管理会社に支払われる。

各月の末日に、当該月中の関連する受益証券クラスの平均日次純資産価額に基づき管理会社に月間管理報酬が支払われる。かかる管理報酬は、個別のサブ・ファンドおよびサブ・ファンドの受益証券クラスごとに異なる率で請求される場合があり、または全額放棄される場合がある。

(略)

第2 管理及び運営**2 買戻し手続等****(2) 日本における買戻し手続等**

<訂正前>

(略)

買戻価額は、申込日の翌銀行営業日（中央欧州標準時）に判明する受益証券1口当たり純資産価格である。

(略)

<訂正後>

（略）

買戻価額は、申込日におけるクラス受益証券1口当たり純資産価格である。

（略）

第3 ファンドの経理状況

1 財務諸表

<訂正前>

（略）

b. ファンドの原文の財務書類は、CSインベストメント・ファンズ・12および全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において日本文の作成にあたっては、関係するサブ・ファンド（クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD）に関連する部分のみを記載してしる。ただし、「財務書類に対する注記」については、全文を記載している。

（略）

<訂正後>

（略）

b. ファンドの原文の財務書類は、CSインベストメント・ファンズ・12および全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において日本文の作成にあたっては、関係するサブ・ファンド（クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD）に関連する部分のみを記載している。ただし、「財務書類に対する注記」については、全文を記載している。

（略）

監査報告書

<訂正前>

クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイの株主各位

ルクセンブルクL-2180、ジャン・モネ通り5番

公認の監査人報告書

財務書類監査に関する報告

監査意見

我々は、クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイ（以下「会社」という。）の2017年12月31日現在の貸借対照表および同日に終了した年度の損益計算書、ならびに重要な会計方針の要約を含む財務書類に対する注記から構成される財務書類にういて監査を行った。

（略）

<訂正後>

クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイの株主各位

ルクセンブルグL-2180、ジャン・モネ通り5番

公認の監査人報告書**財務書類監査に関する報告
監査意見**

我々は、クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイ（以下「会社」という。）の2017年12月31日現在の貸借対照表および同日に終了した年度の損益計算書、ならびに重要な会計方針の要約を含む財務書類に対する注記から構成される財務書類について監査を行った。

（略）