

【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】 令和2年12月25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 フェルナンド・シャウス
(Fernand Schaus, Director)
取締役 シニード・リヨン
(Sinead Lyons, 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, Grand Duchy of 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

【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
(104,600,000,000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
(104,600,000,000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
(104,600,000,000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、2020年7月31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=104.60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】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、令和2年9月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、「第二部 ファンド情報」の「第1 ファンドの状況、5 運用状況」および「第3 ファンドの経理状況」に新たな情報を追加・更新するため、また、「第一部 証券情報」の「（4）発行（売）価格」、「第二部 ファンド情報」の「第1 ファンドの状況、4 手数料等及び税金、（4）その他の手数料等」、「第2 管理及び運営」の「1 申込（販売）手続等、（1）海外における申込（販売）手続等」、「2 買戻し手続等、（1）海外における買戻し手続等」および「（3）受益証券の転換」を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

（1）半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
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 (3) ファンドの仕組み 管理会社の概況	資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加または更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
5 その他		4 管理会社の概況	(3) その他	追加

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。（「5 管理会社の経理の概況」は、訂正内容に該当しないため省略します。）

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

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.）（以下「管理会社」という。）により管理されるアンブレラ・ファンドであるCSインベストメント・ファンズ・12（以下「ファンド」という。）のサブ・ファンドであるクレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USDおよびクレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD（個別にまたは総称して「本サブ・ファンド」といい、本サブ・ファンドと他のサブ・ファンドを総称して「サブ・ファンド」ということがある。）の運用状況は以下のとおりである。

（１）投資状況

資産別および地域別の投資状況

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

（2020年10月末日現在）

資産の種類	国名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
株式	ルクセンブルグ	163,144,870	46.21
	アイルランド	44,854,097	12.70
	アメリカ合衆国	18,662,425	5.29
	スイス	1,514,915	0.43
	フランス	1,017,147	0.29
	ドイツ	793,703	0.22
	オランダ	695,695	0.20
	スペイン	271,906	0.08
	イタリア	213,013	0.06
	フィンランド	148,489	0.04
	オーストリア	143,610	0.04
	スウェーデン	69,480	0.02
	カナダ	7,478	0.00
	小計	231,536,830	65.58
確定利付証券	アメリカ合衆国	72,043,051	20.40
	国際機関	13,569,250	3.84
	ドイツ	8,975,181	2.54
	オーストラリア	3,368,483	0.95
	ノルウェイ	2,678,512	0.76
	フランス	2,370,489	0.67
	カナダ	1,853,478	0.52
	スペイン	1,754,981	0.50
	イタリア	1,694,789	0.48
	オランダ	1,478,543	0.42
	メキシコ	991,980	0.28
	ベルギー	825,827	0.23
	ルクセンブルグ	425,432	0.12
	フィンランド	341,381	0.10
	オーストリア	316,225	0.09

	ポルトガル	273,679	0.08
	ポーランド	250,965	0.07
	アイルランド	126,793	0.04
	小計	113,339,038	32.10
小計		344,875,868	97.67
現金およびその他の資産（負債控除後）		8,209,785	2.33
合計 （純資産総額）		353,085,653 （約36,933百万円）	100.00

（注１）投資比率とは、サブ・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、2020年10月30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＝104.60円）による。以下同じ。

（注３）本サブ・ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設定されているが、本サブ・ファンドの受益証券は、米ドル建てのため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

（2020年10月末日現在）

資産の種類	国名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
株式	ルクセンブルグ	158,653,468	48.86
	アイルランド	62,324,908	19.19
	アメリカ合衆国	29,730,211	9.16
	スイス	2,137,734	0.66
	フランス	679,810	0.21
	ドイツ	591,595	0.18
	オランダ	531,071	0.16
	スペイン	161,880	0.05
	イタリア	136,874	0.04
	フィンランド	55,100	0.02
	オーストリア	53,289	0.02
	スウェーデン	25,782	0.01
	ポルトガル	0	0.00
	カナダ	- 874	- 0.00
	小計	255,080,849	78.55
確定利付証券	アメリカ合衆国	45,238,201	13.93
	ドイツ	6,291,867	1.94
	国際機関	3,209,100	0.99
	カナダ	1,604,681	0.49
	フランス	1,341,949	0.41
	オーストラリア	1,278,563	0.39
	ノルウェイ	1,082,395	0.33
	イタリア	1,062,809	0.33
	スペイン	927,765	0.29
	ベルギー	485,021	0.15
	ポルトガル	273,679	0.08
	ポーランド	250,965	0.08
	ルクセンブルグ	243,104	0.07
	フィンランド	189,656	0.06
	オランダ	187,088	0.06
	オーストリア	164,437	0.05
	アイルランド	126,793	0.04
	小計	63,958,073	19.70
小計		319,038,922	98.24
現金およびその他の資産（負債控除後）		5,702,334	1.76
合計 （純資産総額）		324,741,256 （約33,968百万円）	100.00

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

（2020年10月末日現在）

資産の種類	国名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
株式	ルクセンブルグ	45,626,898	45.66
	アイルランド	23,260,390	23.28
	アメリカ合衆国	16,899,769	16.91
	スイス	740,113	0.74
	フランス	475,276	0.48
	ドイツ	429,865	0.43
	オランダ	389,044	0.39
	スペイン	107,955	0.11
	イタリア	94,291	0.09
	フィンランド	26,849	0.03
	オーストリア	25,967	0.03
	スウェーデン	12,563	0.01
	ポルトガル	0	0.00
	カナダ	- 1,190	- 0.00
	小計	88,087,791	88.16
確定利付証券	アメリカ合衆国	4,271,968	4.28
	ドイツ	1,957,880	1.96
	国際機関	1,474,562	1.48
	ノルウェイ	802,315	0.80
	オーストラリア	601,055	0.60
	カナダ	299,542	0.30
	フランス	146,508	0.15
	ベルギー	83,092	0.08
	スペイン	72,202	0.07
	イタリア	51,765	0.05
	ポーランド	43,919	0.04
	ポルトガル	41,161	0.04
	小計	9,845,968	9.85
小計		97,933,759	98.01
現金およびその他の資産（負債控除後）		1,989,619	1.99
合計 （純資産総額）		99,923,377 （約10,452百万円）	100.00

(2) 運用実績

純資産の推移

2020年10月末日および同日前1年間における各月末の純資産の推移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

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	米ドル	円	クラスB米ドル (acc) 受益証券		クラスBH円建て (acc) 受益証券
			米ドル	円	円
2019年11月末日	365,912,936.60	38,274,493,168	279.33	29,218	10,153
12月末日	373,482,470.19	39,066,266,382	283.24	29,627	10,266
2020年1月末日	373,770,365.60	39,096,380,242	283.57	29,661	10,262
2月末日	368,100,053.00	38,503,265,544	276.75	28,948	10,007
3月末日	322,987,349.64	33,784,476,772	260.56	27,255	9,395
4月末日	334,006,168.94	34,937,045,271	271.33	28,381	9,756
5月末日	341,155,492.22	35,684,864,486	277.80	29,058	9,984
6月末日	347,319,806.32	36,329,651,741	281.48	29,443	10,108
7月末日	357,858,545.48	37,432,003,857	289.22	30,252	10,379
8月末日	359,974,495.88	37,653,332,269	294.03	30,756	10,548
9月末日	357,756,102.29	37,421,288,300	289.58	30,290	10,382
10月末日	353,085,652.54	36,932,759,256	286.69	29,988	10,273

(注) クラスBH円建て (acc) 受益証券は、2017年8月3日に受益証券1口当たり10,000円で運用を開始した。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	米ドル	円	クラスB米ドル（acc） 受益証券		クラスBH円建て （acc）受益証券
			米ドル	円	
2019年11月末日	328,270,451.49	34,337,089,226	293.08	30,656	10,335
12月末日	337,562,468.08	35,309,034,161	298.93	31,268	10,512
2020年1月末日	338,184,448.40	35,374,093,303	298.17	31,189	10,469
2月末日	322,973,850.52	33,783,064,764	286.49	29,967	10,050
3月末日	287,121,088.45	30,032,865,852	263.06	27,516	9,197
4月末日	304,555,829.53	31,856,539,769	278.44	29,125	9,710
5月末日	314,204,396.58	32,865,779,882	286.55	29,973	9,988
6月末日	317,455,283.83	33,205,822,689	291.52	30,493	10,154
7月末日	331,585,930.66	34,683,888,347	301.98	31,587	10,513
8月末日	341,306,687.08	35,700,679,469	310.84	32,514	10,816
9月末日	334,868,902.69	35,027,287,221	304.56	31,857	10,590
10月末日	324,741,255.94	33,967,935,371	299.93	31,373	10,423

（注）クラスBH円建て（acc）受益証券は、2017年8月4日に受益証券1口当たり10,000円で運用を開始した。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	米ドル	円	クラスB米ドル（acc） 受益証券		クラスBH円建て （acc）受益証券
			米ドル	円	
2019年11月末日	122,571,405.35	12,820,969,000	281.77	29,473	10,301
12月末日	116,928,217.33	12,230,691,533	289.28	30,259	10,547
2020年1月末日	97,643,231.32	10,213,481,996	287.14	30,035	10,450
2月末日	96,572,968.87	10,101,532,544	270.65	28,310	9,850
3月末日	86,710,192.70	9,069,886,156	241.43	25,254	8,749
4月末日	94,849,125.73	9,921,218,551	260.48	27,246	9,412
5月末日	98,466,744.73	10,299,621,499	269.64	28,204	9,743
6月末日	99,846,054.50	10,443,897,301	275.41	28,808	9,941
7月末日	104,597,003.11	10,940,846,525	287.23	30,044	10,363
8月末日	111,113,270.44	11,622,448,088	299.50	31,328	10,804
9月末日	102,710,776.82	10,743,547,255	291.47	30,488	10,508
10月末日	99,923,377.09	10,451,985,244	285.55	29,869	10,291

（注）クラスBH円建て（acc）受益証券は、2017年7月12日に受益証券1口当たり10,000円で運用を開始した。ただし、2018年1月11日および2018年7月19日に、それぞれ全投資家の買戻しにより投資家が0となり、その後、2018年1月31日および2018年8月17日に受益証券1口当たり10,000円で再度当初募集を行った。

分配の推移

2020年10月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、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

該当事項なし。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

該当事項なし。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

該当事項なし。

収益率の推移

2020年10月末日までの1年間の収益率は、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

期間	収益率（注1）	
	クラスB米ドル（acc） 受益証券	クラスBH円建て（acc） 受益証券
2019年11月1日～ 2020年10月末日	3.13%	1.50%

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

期間	収益率（注1）	
	クラスB米ドル（acc） 受益証券	クラスBH円建て（acc） 受益証券
2019年11月1日～ 2020年10月末日	3.41%	1.73%

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

期間	収益率（注1）	
	クラスB米ドル（acc） 受益証券	クラスBH円建て（acc） 受益証券
2019年11月1日～ 2020年10月末日	3.02%	1.38%

（注1）収益率（%）＝100×（a－b）／b

a＝当該期間最終日の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b＝当該期間の直前の日の1口当たり純資産価格（分配落ちの額）

また、ファンドの暦年ベースでの収益率は次のとおりである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

期間	収益率（注2）	
	クラスB米ドル（acc） 受益証券	クラスBH円建て（acc） 受益証券
2010年	8.24%	-
2011年	- 1.77%	-
2012年	6.87%	-
2013年	0.81%	-
2014年	1.42%	-
2015年	- 2.12%	-
2016年	2.57%	-
2017年	7.32%	1.46%
2018年	- 4.83%	- 7.29%
2019年	12.26%	9.14%
2020年	1.22%	0.07%

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

期間	収益率（注2）	
	クラスB米ドル（acc） 受益証券	クラスBH円建て（acc） 受益証券
2010年	8.96%	-
2011年	- 5.39%	-
2012年	9.76%	-
2013年	4.79%	-
2014年	0.61%	-
2015年	- 2.70%	-
2016年	3.28%	-
2017年	11.29%	2.82%
2018年	- 6.79%	- 9.20%
2019年	15.75%	12.60%
2020年	0.33%	- 0.85%

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

期間	収益率（注２）	
	クラスB米ドル（acc） 受益証券	クラスBH円建て（acc） 受益証券
2010年	10.05%	-
2011年	- 10.05%	-
2012年	12.66%	-
2013年	9.18%	-
2014年	- 0.33%	-
2015年	- 3.66%	-
2016年	3.77%	-
2017年	15.89%	6.13%
2018年	- 8.85%	- 14.64%
2019年	19.45%	16.43%
2020年	- 1.29%	- 2.43%

（注２）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 暦年末（2020年については10月末日）の１口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b = 当該暦年の直前の暦年末の１口当たり純資産価格（分配落ちの額）

（クラスBH円建て（acc）受益証券については、2017年は10,000円）

なお、ファンドにはベンチマークはない。

< 参考情報 >

純資産総額および１口当たり純資産価格の推移（2020年10月末日現在）

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

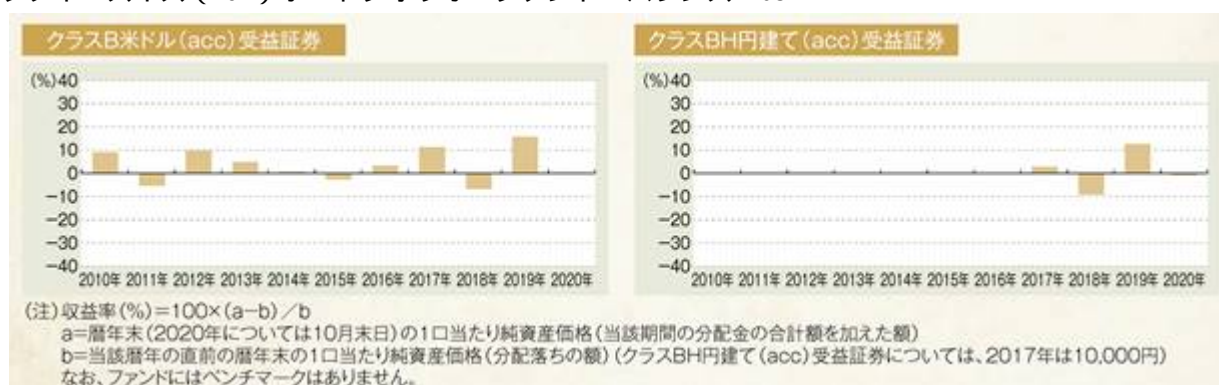


収益率の推移（暦年ベース）

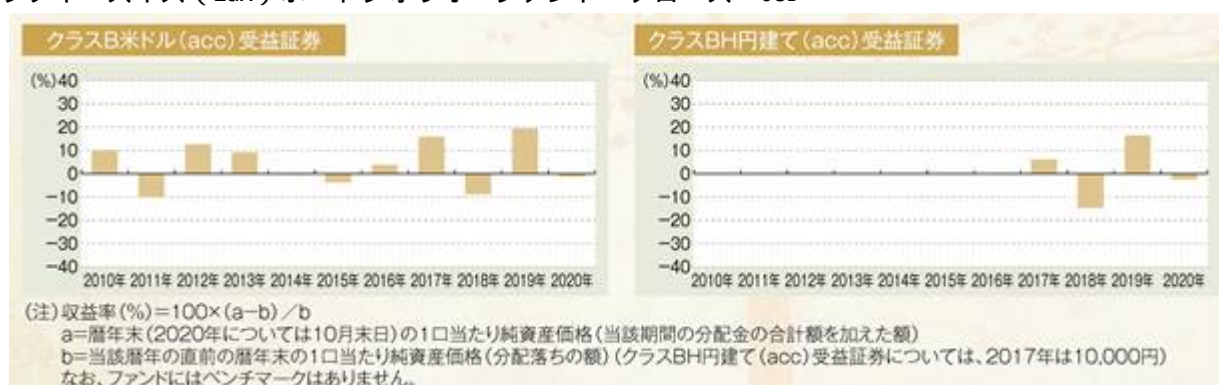
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD



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

[次へ](#)

2 販売及び買戻しの実績

2020年10月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2020年10月末日現在の発行済口数は次のとおりである。

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

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年11月1日～	44,824	126,262	780,774
2020年10月末日	(12,725)	(6,887)	(154,281)

クラスBH円建て（acc）受益証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年11月1日～	12,608	4,829	32,452
2020年10月末日	(12,608)	(4,829)	(32,452)

（注1）（ ）の数は本邦における販売・買戻しおよび発行済口数。以下同じ。

（注2）販売、買戻しおよび発行済口数については、小数点以下を四捨五入して整数で表示している。よって合計額が一致しないことがある。以下同じ。

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

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年11月1日～	123,824	177,833	652,721
2020年10月末日	(91,481)	(110,210)	(314,680)

クラスBH円建て（acc）受益証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年11月1日～	19,215	68,560	153,781
2020年10月末日	(19,215)	(68,560)	(153,781)

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

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年11月1日～	42,623	123,900	268,150
2020年10月末日	(28,461)	(104,757)	(48,683)

クラスBH円建て（acc）受益証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年11月1日～	36,582	521	38,018
2020年10月末日	(36,582)	(521)	(37,888)

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文（英文）の中間財務書類を日本語に翻訳したものである。ファンドの日本語の中間財務書類は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定に準拠して作成されている。

ファンドの原文の中間財務書類は、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。本書において日本語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およびクレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・ワールド・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。

ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいいます。）の監査を受けていない。

ファンドの原文の中間財務書類は、スイス・フランおよび米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円換算が併記されている。円換算による金額は、2020年10月30日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1スイス・フラン＝114.29円、1米ドル＝104.60円）を使用して換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）資産及び負債の状況

CSインベストメント・ファンズ・12

- 結合計算書

純資産計算書（スイス・フランで表示）

	2020年9月30日現在	
	（スイス・フラン）	（千円）
資産		
投資証券 - 時価	4,331,177,046.48	495,010,225
銀行預金およびブローカー預金	84,701,449.15	9,680,529
未収収益	4,587,891.82	524,350
先物為替契約に係る未実現純利益	544,513.21	62,232
その他の資産	765.61	88
	4,421,011,666.27	505,277,423
負債		
銀行およびブローカーへの未払金	98,540.34	11,262
未払利息	11.43	1
未払費用引当金	5,574,052.60	637,058
先物為替契約に係る未実現純損失	12,680,999.94	1,449,311
	18,353,604.31	2,097,633
純資産	4,402,658,061.96	503,179,790

注記は当財務書類の一部である。

CSインベストメント・ファンズ・12

- 結合計算書

運用計算書 / 純資産変動計算書（スイス・フランで表示）

	2020年4月1日から 2020年9月30日までの期間 (スイス・フラン)	(千円)
期首現在純資産	4,053,317,610.26	463,253,670
収益		
投資証券に係る利息（純額）	12,671,637.03	1,448,241
配当金（純額）	11,816,971.95	1,350,562
銀行利息	495.41	57
証券貸付収益	127,652.60	14,589
その他の収益	123,155.58	14,075
	24,739,912.57	2,827,525
費用		
管理報酬	27,971,099.54	3,196,817
保管報酬	1,349,822.33	154,271
管理事務代行費用	1,296,714.15	148,201
印刷および公告費	70,639.89	8,073
利息および銀行手数料	134,711.61	15,396
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	374,114.23	42,758
年次税	589,632.48	67,389
	31,786,734.23	3,632,906
純利益（損失）	(7,046,821.66)	(805,381)
実現利益（損失）		
投資対象売却	693,655,679.77	79,277,908
先物為替契約	79,942,322.77	9,136,608
外国為替	(2,065,568.82)	(236,074)
	771,532,433.72	88,178,442
実現純利益（損失）	764,485,612.06	87,373,061
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	(303,792,872.96)	(34,720,487)
先物為替契約	(31,692,021.13)	(3,622,081)
	(335,484,894.09)	(38,342,569)
運用の結果による純資産の純増加（減少）	429,000,717.97	49,030,492
申込み / 買戻し		
申込み	408,709,073.84	46,711,360
買戻し	(471,269,325.06)	(53,861,371)
	(62,560,251.22)	(7,150,011)
分配金	(628,514.95)	(71,833)
為替換算調整	(16,471,500.10)	(1,882,528)
期末現在純資産	4,402,658,061.96	503,179,790

注記は当財務書類の一部である。

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・バランス・USD

テクニカル・データおよび注記

テクニカル・データ

	Valoren	ISIN	管理報酬	総費用比率
クラスB米ドル（acc）	672327	LU0078041133	1.50%	2.05%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	28145643	LU1230136977	0.60%	1.13%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	1057436	LU0108835801	0.60%	1.15%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	26362734	LU1144411391	1.25%	1.80%
クラスBH円建て（acc）	36829019	LU1614284856	1.50%	2.15%

ファンド・パフォーマンス

	年初来	設定来	2019年	2018年	2017年
クラスB米ドル（acc）	1.88%	/	15.75%	- 6.79%	11.29%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	2.59%	/	16.79%	- 6.01%	12.16%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	2.57%	/	16.75%	- 6.00%	12.23%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	2.07%	/	16.03%	- 6.57%	11.56%
クラスBH円建て（acc）	0.74%	5.90%	12.60%	- 9.20%	/

注記

先物為替契約

買い 取引相手方		売り		満期日 (日 - 月 - 年)	評価額 (米ドル)
日本円	497,260,600	米ドル	-4,649,528	09.10.2020	62,951.87
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	512,225,600	米ドル	-4,837,748	10.11.2020	18,290.69
UBS AG London/London Branch					
日本円	14,965,000	米ドル	-141,285	09.10.2020	536.31
UBS AG London/London Branch					
米ドル	7,688,697	ユーロ	-6,450,000	10.11.2020	118,677.47
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	132,165	スイス・フラン	-120,000	10.11.2020	1,400.70
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	1,033,443	カナダ・ドル	-1,360,000	10.11.2020	15,148.04
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	369,181	豪ドル	-510,000	10.11.2020	3,603.27
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	197,833	英ポンド	-150,000	10.11.2020	3,868.90
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
日本円	513,669,200	米ドル	-4,841,558	09.12.2020	30,300.66
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	1,443,600	米ドル	-13,602	10.11.2020	83.99
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	1,443,600	米ドル	-13,597	09.10.2020	84.22
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	100,323,800	米ドル	-945,090	09.10.2020	5,666.32
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	371,501	日本円	-39,242,400	09.10.2020	-394.45
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
先物為替契約に係る未実現純利益					260,217.99

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・バランス・USD

純資産計算書（米ドルで表示）およびファンドの推移

	2020年9月30日現在	
	（米ドル）	（千円）
資産		
投資証券 - 時価	326,165,728.67	34,116,935
銀行預金およびブローカー預金	8,555,535.11	894,909
未収収益	322,482.56	33,732
先物為替契約に係る未実現純利益	260,217.99	27,219
その他の資産	94.83	10
	335,304,059.16	35,072,805

負債		
銀行およびブローカーへの未払金	12,747.88	1,333
未払費用引当金	422,408.59	44,184
	435,156.47	45,517

純資産	334,868,902.69	35,027,287
------------	----------------	------------

ファンドの推移	2020年9月30日現在	2020年3月31日現在	2019年3月31日現在
純資産総額（米ドル）	334,868,902.69	287,121,088.45	322,314,020.43

1口当たり純資産価格			
クラスB米ドル（acc）	304.56	263.06	278.37
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	1,265.92	1,088.44	1,141.26
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	1,376.69	1,183.80	1,241.64
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	124.21	107.15	113.11
クラスBH円建て（acc）	10,590.00	9,197.00	9,994.00

発行済受益証券口数	期末現在	期首現在	発行口数	買戻口数
クラスB米ドル（acc）	661,879.417	699,546.663	44,799.312	82,466.558
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	15,669.050	15,811.165	365.051	507.166
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	35,420.637	25,773.024	10,486.463	838.850
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	396,579.980	406,072.113	16,715.418	26,207.551
クラスBH円建て（acc）	153,780.857	139,262.432	14,518.425	0.000

注記は当財務書類の一部である。

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・バランス・USD

運用計算書 / 純資産変動計算書（米ドルで表示）

	2020年4月1日から 2020年9月30日までの期間 (米ドル)	(千円)
期首現在純資産	287,121,088.45	30,032,866
収益		
投資証券に係る利息（純額）	1,001,264.77	104,732
配当金（純額）	759,232.91	79,416
銀行利息	10.62	1
証券貸付収益	7,656.89	801
その他の収益	6,512.65	681
	1,774,677.84	185,631
費用		
管理報酬	2,080,864.59	217,658
保管報酬	99,722.32	10,431
管理事務代行費用	95,733.30	10,014
印刷および公告費	6,315.68	661
利息および銀行手数料	5,493.18	575
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	36,818.40	3,851
年次税	43,477.25	4,548
	2,368,424.72	247,737
純利益（損失）	(593,746.88)	(62,106)
実現利益（損失）		
投資対象売却	54,296,846.38	5,679,450
先物為替契約	(386,220.43)	(40,399)
外国為替	29,243.10	3,059
	53,939,869.05	5,642,110
実現純利益（損失）	53,346,122.17	5,580,004
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	(7,680,776.39)	(803,409)
先物為替契約	87,138.55	9,115
	(7,593,637.84)	(794,295)
運用の結果による純資産の純増加（減少）	45,752,484.33	4,785,710
申込み / 買戻し		
申込み	30,763,892.02	3,217,903
買戻し	(28,768,562.11)	(3,009,192)
	1,995,329.91	208,712
期末現在純資産	334,868,902.69	35,027,287

注記は当財務書類の一部である。

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・グロース・USD

テクニカル・データおよび注記

テクニカル・データ

	Valoren	ISIN	管理報酬	総費用比率
クラスB米ドル（acc）	672380	LU0078042453	1.70%	2.28%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	28146665	LU1230137272	0.60%	1.15%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	28234316	LU1230137512	0.60%	/
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	26362879	LU1144411631	1.40%	1.97%
クラスBH円建て（acc）	36829025	LU1614285234	1.70%	2.26%

ファンド・パフォーマンス

	年初来	設定来	2019年	2018年	2017年
クラスB米ドル（acc）	0.76%	/	19.45%	- 8.85%	15.89%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	1.61%	/	20.76%	- 7.93%	16.90%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	/	/	20.72%	/	/
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	0.98%	/	19.79%	- 8.58%	16.22%
クラスBH円建て（acc）	-0.37%	5.08%	16.43%	- 14.64%	/

注記

先物為替契約

買い 取引相手方		売り		満期日 (日 - 月 - 年)	評価額 (米ドル)
日本円	80,395,000	米ドル	-751,716	09.10.2020	10,177.80
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	83,259,000	米ドル	-786,345	10.11.2020	2,973.03
UBS AG London/London Branch					
日本円	2,864,000	米ドル	-27,039	09.10.2020	102.64
UBS AG London/London Branch					
英ポンド	10,000	米ドル	-13,189	10.11.2020	-257.98
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	477,764	豪ドル	-660,000	10.11.2020	4,663.05
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	402,739	カナダ・ドル	-530,000	10.11.2020	5,903.28
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
スイス・フラン	10,000	米ドル	-11,014	10.11.2020	-116.85
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	452,977	ユーロ	-380,000	10.11.2020	6,991.86
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
日本円	49,433,000	米ドル	-465,587	09.10.2020	2,883.88
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	132,692,000	米ドル	-1,250,680	09.12.2020	7,827.32
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	49,433,000	米ドル	-465,762	10.11.2020	2,876.16
CITIBANK N.A. LONDON					
日本円	5,017,600	米ドル	-47,267	09.10.2020	284.11
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
米ドル	84,631	日本円	-8,885,900	09.10.2020	420.02
CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG					
先物為替契約に係る未実現純利益					44,728.32

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・グロース・USD

純資産計算書（米ドルで表示）およびファンドの推移

	2020年9月30日現在	
	（米ドル）	（千円）
資産		
投資証券 - 時価	100,240,058.06	10,485,110
銀行預金およびブローカー預金	2,550,828.68	266,817
未収収益	54,359.21	5,686
先物為替契約に係る未実現純利益	44,728.32	4,679
その他の資産	172.94	18
	102,890,147.21	10,762,309

負債		
銀行およびブローカーへの未払金	23,247.47	2,432
未払費用引当金	156,122.92	16,330
	179,370.39	18,762

純資産	102,710,776.82	10,743,547
------------	----------------	------------

ファンドの推移	2020年9月30日現在	2020年3月31日現在	2019年3月31日現在
純資産総額（米ドル）	102,710,776.82	86,710,192.70	117,169,163.33

1口当たり純資産価格			
クラスB米ドル（acc）	291.47	241.43	265.84
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	1,305.60	1,075.41	1,170.99
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	/	/	1,025.99
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	129.66	107.24	117.73
クラスBH円建て（acc）	10,508.00	8,749.00	9,875.00

発行済受益証券口数	期末現在	期首現在	発行口数	買戻口数
クラスB米ドル（acc）	265,812.464	279,926.486	13,966.157	28,080.179
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	6,698.541	6,868.650	667.609	837.718
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	0.000	0.000	0.000	0.000
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	97,970.444	96,546.555	3,465.769	2,041.880
クラスBH円建て（acc）	38,017.907	17,118.374	21,420.240	520.707

注記は当財務書類の一部である。

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・グロース・USD

運用計算書 / 純資産変動計算書（米ドルで表示）

	2020年4月1日から 2020年9月30日までの期間 （米ドル）	（千円）
期首現在純資産	86,710,192.70	9,069,886
収益		
投資証券に係る利息（純額）	165,201.50	17,280
配当金（純額）	348,124.13	36,414
銀行利息	24.32	3
証券貸付収益	1,742.05	182
その他の収益	972.01	102
	516,064.01	53,980
費用		
管理報酬	787,996.74	82,424
保管報酬	31,437.13	3,288
管理事務代行費用	30,179.65	3,157
印刷および公告費	3,570.15	373
利息および銀行手数料	5,000.75	523
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	17,682.45	1,850
年次税	14,435.42	1,510
	890,302.29	93,126
純利益（損失）	(374,238.28)	(39,145)
実現利益（損失）		
投資対象売却	19,008,486.15	1,988,288
先物為替契約	(108,964.99)	(11,398)
外国為替	13,503.04	1,412
	18,913,024.20	1,978,302
実現純利益（損失）	18,538,785.92	1,939,157
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	(282,319.95)	(29,531)
先物為替契約	41,811.43	4,373
	(240,508.52)	(25,157)
運用の結果による純資産の純増加（減少）	18,298,277.40	1,914,000
申込み / 買戻し		
申込み	7,114,503.10	744,177
買戻し	(9,412,196.38)	(984,516)
	(2,297,693.28)	(240,339)
期末現在純資産	102,710,776.82	10,743,547

注記は当財務書類の一部である。

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

テクニカル・データおよび注記

テクニカル・データ

	Valoren	ISIN	管理報酬	総費用比率
クラスA - 分配型（米ドル）	672336	LU0078046876	1.30%	1.86%
クラスB米ドル（acc）	672337	LU0078046959	1.30%	1.85%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	28145654	LU1230137199	0.60%	1.12%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	28234308	LU1230137439	0.60%	1.14%
クラスUA - 分配型（米ドル）	26362951	LU1144412100	1.05%	1.59%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	26364579	LU1144412282	1.05%	1.61%
クラスBH円建て（acc）	36829010	LU1614284344	1.30%	1.91%

ファンド・パフォーマンス

	年初来	設定来	2019年	2018年	2017年
クラスA - 分配型（米ドル）	2.25%	/	12.25%	- 4.83%	7.32%
クラスB米ドル（acc）	2.24%	/	12.26%	- 4.83%	7.32%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	2.80%	/	13.05%	- 4.17%	8.06%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	2.78%	/	13.01%	- 4.21%	8.02%
クラスUA - 分配型（米ドル）	2.43%	/	12.52%	- 4.60%	7.57%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	2.43%	/	12.53%	- 4.61%	7.57%
クラスBH円建て（acc）	1.13%	3.82%	9.14%	- 7.29%	/

分配金

	分配落ち日 (日 - 月 - 年)	金額
クラスA - 分配型（米ドル）	19.05.2020	0.51
クラスUA - 分配型（米ドル）	19.05.2020	0.62

注記

先物為替契約

買い 取引相手方		売り		満期日 (日 - 月 - 年)	評価額 (米ドル)
日本円 CITIBANK N.A. LONDON	100,982,300	米ドル	-944,213	09.10.2020	12,784.09
日本円 UBS AG London/London Branch	2,299,700	米ドル	-21,712	09.10.2020	82.41
日本円 UBS AG London/London Branch	103,282,000	米ドル	-975,454	10.11.2020	3,688.02
米ドル CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG	263,777	英ポンド	-200,000	10.11.2020	5,158.52
米ドル CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG	535,675	豪ドル	-740,000	10.11.2020	5,228.27
米ドル CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG	1,534,966	カナダ・ドル	-2,020,000	10.11.2020	22,499.29
米ドル CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG	242,302	スイス・フラン	-220,000	10.11.2020	2,567.96
米ドル CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG	14,876,734	ユーロ	-12,480,000	10.11.2020	229,627.10
日本円 CITIBANK N.A. LONDON	103,311,700	米ドル	-973,758	09.12.2020	6,094.22
日本円 CITIBANK N.A. LONDON	29,700	米ドル	-280	09.10.2020	1.73
日本円 CITIBANK N.A. LONDON	29,700	米ドル	-280	10.11.2020	1.72
先物為替契約に係る未実現純利益					287,733.33

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

純資産計算書（米ドルで表示）およびファンドの推移

2020年 9 月30日現在				
	(米ドル)	(千円)		
資産				
投資証券 - 時価	351,902,826.40	36,809,036		
銀行預金およびブローカー預金	5,413,859.43	566,290		
未収収益	565,565.47	59,158		
先物為替契約に係る未実現純利益	287,733.33	30,097		
	358,169,984.63	37,464,580		
負債				
未払費用引当金	413,882.34	43,292		
	413,882.34	43,292		
純資産	357,756,102.29	37,421,288		
ファンドの推移				
	2020年 9 月30日現在	2020年 3 月31日現在	2019年 3 月31日現在	
純資産総額 (米ドル)	357,756,102.29	322,987,349.64	339,693,928.62	
1 口当たり純資産価格				
クラス A - 分配型 (米ドル)	157.63	142.32	147.33	
クラス B 米ドル (acc)	289.58	260.56	267.37	
クラス EB - 元本成長型 (米ドル)	1,211.96	1,086.57	1,106.98	
クラス IB - 元本成長型 (米ドル)	1,205.02	1,080.46	1,101.16	
クラス UA - 分配型 (米ドル)	113.03	102.17	105.78	
クラス UB - 元本成長型 (米ドル)	118.25	106.27	108.77	
クラス BH 円建て (acc)	10,382.00	9,395.00	9,895.00	
発行済受益証券口数				
	期末現在	期首現在	発行口数	買戻口数
クラス A - 分配型 (米ドル)	129,567.894	127,678.938	5,234.907	3,345.951
クラス B 米ドル (acc)	785,936.351	802,905.053	21,776.382	38,745.084
クラス EB - 元本成長型 (米ドル)	7,121.474	7,536.944	571.230	986.700
クラス IB - 元本成長型 (米ドル)	40,605.975	38,177.192	2,868.381	439.598
クラス UA - 分配型 (米ドル)	163,462.654	154,698.126	16,459.544	7,695.016
クラス UB - 元本成長型 (米ドル)	257,323.287	261,511.165	44,761.392	48,949.270
クラス BH 円建て (acc)	29,610.678	29,610.678	0.000	0.000

注記は当財務書類の一部である。

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

運用計算書 / 純資産変動計算書（米ドルで表示）

	2020年4月1日から 2020年9月30日までの期間 (米ドル)	(千円)
期首現在純資産	322,987,349.64	33,784,477
収益		
投資証券に係る利息（純額）	1,652,022.31	172,802
配当金（純額）	473,560.08	49,534
銀行利息	55.42	6
証券貸付収益	10,858.57	1,136
その他の収益	8,539.44	893
	2,145,035.82	224,371
費用		
管理報酬	2,007,684.43	210,004
保管報酬	108,211.19	11,319
管理事務代行費用	104,040.05	10,883
印刷および公告費	7,624.58	798
利息および銀行手数料	5,308.69	555
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	35,639.20	3,728
年次税	47,993.72	5,020
	2,316,501.86	242,306
純利益（損失）	(171,466.04)	(17,935)
実現利益（損失）		
投資対象売却	56,851,600.10	5,946,677
先物為替契約	(1,268,218.27)	(132,656)
外国為替	(76,304.08)	(7,981)
	55,507,077.75	5,806,040
実現純利益（損失）	55,335,611.71	5,788,105
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	(19,338,496.62)	(2,022,807)
先物為替契約	367,950.99	38,488
	(18,970,545.63)	(1,984,319)
運用の結果による純資産の純増加（減少）	36,365,066.08	3,803,786
申込み / 買戻し		
申込み	18,034,158.37	1,886,373
買戻し	(19,470,331.73)	(2,036,597)
	(1,436,173.36)	(150,224)
分配金	(160,140.07)	(16,751)
期末現在純資産	357,756,102.29	37,421,288

注記は当財務書類の一部である。

注記（2020年9月30日現在）

一般事項

CSインベストメント・ファンズ・12（以下「ファンド」という。）は、サブ・ファンドを有するルクセンブルグのミューチュアル・インベストメント・ファンド（以下「アンブレラ・ファンド」という。）である。ファンドは、改正済みの2010年12月17日法パートIに基づく譲渡性のある証券を集团的投資の対象とする投資信託としてルクセンブルグにおいて登録されている。

2020年9月30日現在、ファンドは9本のサブ・ファンドを有する。

変更：

クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイの決定に従い、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・レディット・EURは、2020年7月1日付でクレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・EURに合併された。

重要な会計方針の要約

a）財務書類の表示

ファンドの財務書類は、投資信託に関するルクセンブルグの法令上の要件に準拠して作成される。

b）各サブ・ファンドの純資産価額の計算

各サブ・ファンドの受益証券の純資産価額は、それぞれのサブ・ファンドの参照通貨で計算され、管理会社が、ルクセンブルグにおいて銀行が、通常、全日営業を行っている各銀行営業日（以下「評価日」という。）にルクセンブルグにおいて決定するものとする。

各サブ・ファンドの純資産価額は、同日までに発生した収益／費用、および直近の入手可能な市場価格に基づく純資産の評価に基づいて、毎日決定される。

財務書類は、2020年9月30日現在の投資の市場価格に基づく2020年9月30日現在の純資産価額を反映している。

投資運用会社は、申込みまたは買戻しの結果として望ましい資産配分を維持するために取引を行う必要があり、これにより、サブ・ファンドおよびその受益者に追加費用が発生する可能性がある。このため、既存受益者の利益を保護するために、これらの元本の変動から、元本の変動純額が管理会社の取締役会により予め定められた閾値を超える場合、1口当たりの純資産価格の調整が適用される。この調整は、これらの取引の結果としてサブ・ファンドが負担する可能性がある見積税額および取引費用、ならびにサブ・ファンドが投資する資産の見積売買差額を反映している。適用されているスイングファクターの妥当性を検証するために、定期的な見直しが行われる。

統計情報に開示されている1口当たりの純資産価格は、公表されている1口当たりの純資産価格であるのに対し、純資産計算書に開示されている純資産総額は、期末のスイング調整を除いた純資産総額である。

ファンドは、部分的にスイングプライシングを適用する。計算される純資産価額は、各評価日において受領した申込みに関し、発行申込みにより純剰余金が生じている場合、受益証券1口当たり最大2%の引き上げ、または買戻申請により純剰余金が生じている場合、受益証券1口当たり最大2%の引下げが行われる。

2020年9月30日現在、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USDにスイングプライシングが適用された。

c）各サブ・ファンドの投資証券の評価

証券取引所に上場されている、または通常の取引が行われている証券は、入手可能な直近の売値で評価される。かかる価格が特定の取引日について入手できない場合、最終の仲値（最終買呼値と最終売呼値の仲値）またはその代わりとして最終買呼値を評価の基準とすることができる。

複数の証券取引所で取引されている証券の場合、評価は当該証券の主要市場である取引所を参照して行われる。

証券取引所での取引が顕著ではないが、証券ディーラー間の取引が規制されている（価格が市況を反映する）流通市場で取引されている証券の場合、評価は、当該流通市場を基準とすることができる。

規制された市場で取引されている証券は、証券取引所に上場されている証券と同じ方法で評価される。

証券取引所に上場されておらず、規制された市場でも取引されていない証券は、その入手可能な直近の市場価格で評価される。かかる価格が入手できない場合、管理会社は、管理会社が定める他の基準に従い、その価値が慎重かつ誠実に見積られた推定売値を基準として当該証券を評価する。

特定の状況または状況の変化により上記の規則に準拠した評価が不可能または不正確となった場合、管理会社は、当該サブ・ファンドの資産の適切な評価を得るために、他の一般に認められた監査可能な評価原則を用いることができる。

d）銀行預金およびブローカー預金

銀行預金およびブローカー預金には、手許現金、追加証拠金、要求払預金および当座借越が含まれる。

e）各サブ・ファンドの投資対象売却に係る実現純損益

証券の売却に係る実現損益は、平均取得原価に基づき計算される。

f）為替換算

財務書類は、各サブ・ファンドの参照通貨で維持され、結合財務書類はスイス・フランで維持される。

銀行預金、その他の純資産および各サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨建てのポートフォリオ証券の価額は、評価日の実勢為替レートで参照通貨に換算される。

各サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨建ての収益および費用は、それらがサブ・ファンドに発生した日に適用される為替レートで参照通貨に換算される。

為替差損益は、運用計算書／純資産変動計算書に計上される。

各サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨建ての証券の取得原価は、取得日に有効な為替レートで参照通貨に換算される。

g）各サブ・ファンドの投資証券取引

投資証券取引は、取引日ベースで計上される。

h）各サブ・ファンドの金融先物契約の評価

期日未到来の金融先物契約は、当該日時点の実勢市場レートで評価日に評価し、その結果生じた未実現損益の変動は、運用計算書／純資産変動計算書に計上され、金融先物契約の未実現損益として純資産計算書に表示される。実現損益もまた、「金融先物契約の実現純損益」として運用計算書／純資産変動計算書に計上される。

i) 各サブ・ファンドの先物為替契約の評価

期日未到来の先物為替契約は、当該日時点の実勢先物為替レートで評価日に評価し、その結果生じた未実現損益の変動は、運用計算書／純資産変動計算書に計上され、先物為替契約の未実現損益として純資産計算書に表示される。実現損益もまた、「先物為替契約の実現純損益」として運用計算書／純資産変動計算書に計上される。

j) 未払費用の割り当て

サブ・ファンドに直接割り当てられる未払費用は、当該サブ・ファンドに請求される。直接割り当てることができない未払費用は、各サブ・ファンドの純資産額に比例してサブ・ファンドの間で分割される。

k) 証券貸付

ファンドは、サブ・ファンドのポートフォリオに含まれる証券の貸付を行うことができる。ファンドは、公認の証券補償機関またはこの種の業務に特化した一流の金融機関が組織する証券貸付の標準化されたシステムの範囲内でのみ証券を貸付けることができる。証券貸付からの収益は、証券貸付からの総収益から、証券貸付の当事者になる取引相手方が保持する直接的および間接的な費用および手数料を差し引いたものを示している。

l) 収益の認識

配当収益は、源泉徴収税を控除した後、分配落ち日に計上される。利息収益は、源泉徴収税を控除し、比例配分ベースで発生する。

管理報酬

（サブ・ファンドごとの詳細を参照）

管理会社は、そのサービスに対する報酬および費用の払い戻しとして、管理報酬（サブ・ファンドごとの詳細を参照）を受け取る権利を有する。かかる報酬は、該当月における各受益証券クラスの平均日次純資産価額に基づき計算され、各月の月末に支払われる。さらに、管理報酬には前期に関連してこの期間に請求された管理報酬の調整額を含んでいる。

年次税

現行法および規則に基づき、ファンドは、ルクセンブルグにおいてその投資に基づき年率0.05%の年次税を課される。かかる年次税は、各四半期末に各サブ・ファンドの純資産に基づき計算され、四半期ごとに支払われる。機関投資家のみが取得できる受益証券クラスの場合、年間税率は0.01%である。

ルクセンブルグ法に基づくその他の投資信託に投資される純資産の部分は、当該税金を免除される。

総費用比率（TER）

（サブ・ファンドごとの詳細を参照）

TERは、ファンドの資産に継続的に請求されるすべての費用および手数料の合計を表しており、その平均資産に対する比率として遡及的に行われる。

TERは、SFAMAガイドラインに従って計算される。

期末まで6か月以内に開始された受益証券について、TERは開示されていない。また報告年度中に償還された受益証券についても開示されていない。

サブ・ファンドが、ファンド・オブ・ファンズとして、その純資産の少なくとも10%を投資対象ファンドに投資する場合、ファンド・オブ・ファンズのT E Rの構成は以下のように計算される。

パフォーマンス関連の報酬を含む個々の投資対象ファンドの比例T E Rは、期末日時点のファンド・オブ・ファンズの総資産に占める割合に応じて加重され、ファンド・オブ・ファンズのT E Rから報告年度中に投資対象ファンドから受け取った遡及手数料を差し引く。

証券ポートフォリオの構成の変動

報告期間中の証券ポートフォリオの構成の変動については、管理会社の登録事務所またはファンドが登録されている国の現地代理店において、受益者は無料で入手することができる。

為替レート

結合財務書類は、スイス・フランで維持される。このため、サブ・ファンドの財務書類は、2020年9月30日現在の為替レートでスイス・フランに換算される。

1 ユーロ = 1.077350 スイス・フラン

1 米ドル = 0.918731 スイス・フラン

ファンドのパフォーマンス

（サブ・ファンドごとの詳細を参照）

Y年のパフォーマンスは、Y年（それぞれY - 1年）の最終営業日に計算された純資産価額に基づく。当該純資産価額は、Y年（それぞれY - 1年）の最終営業日における投資の市場価格を反映している。

年初来のパフォーマンスは、2020年1月1日から2020年9月30日までの期間が含まれる。

過去のパフォーマンスは、現在および将来のパフォーマンスの指標にならない。

パフォーマンス・データは、ファンド受益証券の購入または買戻しにかかる手数料および費用を考慮していない。

3年以上前に運用を開始した受益証券について、設定来のパフォーマンスは開示されない。

分配型受益証券のパフォーマンスには、分配金の再投資が含まれる。

パフォーマンスは、受益証券1口当たりのスイング済み純資産価格に基づき計算される。

証券貸付

サブ・ファンドは、以下のとおりチューリッヒのクレディ・スイス（スイス）リミテッドとの「証券貸付」システムに参加した。

サブ・ファンド	通貨	貸株時価	担保時価
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・EUR	ユーロ	12,598,298.00	13,247,761.07
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・CHF	スイス・フラン	56,826,164.00	59,755,646.61
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD	米ドル	13,240,788.00	13,923,372.49
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・EUR	ユーロ	479,075.00	503,772.11
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・CHF	スイス・フラン	4,793,270.00	5,040,370.99
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD	米ドル	8,012.00	8,425.03
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・EUR	ユーロ	35,391,662.00	37,216,160.63

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・CHF	スイス・フラン	64,655,545.00	67,988,645.14
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD	米ドル	46,399,729.00	48,791,711.67

証券貸付相手方がファンドに引き渡す担保は、以下で構成される十分に分散されたポートフォリオから成る。

- ・ 政府、政府機関、公法で規制されている団体または厳選されたOECD加盟国による企業（クレディ・スイスの関連会社を除く）が発行または保証する高格付けの債券
- ・ 国際機関による高格付けの債券
- ・ 受益証券が主要インデックスと流動性インデックスに組み入れられることを条件に、OECDにおいて特定の証券取引所に上場されている株式

担保の時価の決定は、担保の種類のボラティリティに適合した適切なヘアカットの適用を条件とする。

運用計算書／純資産変動計算書の「証券貸付収益」に記載されている収益は、貸付元本から受領した純額である。直接および間接的な運用費用および手数料は、その手数料から負担され、元本が負う債務リスクを含む。

2020年9月30日に終了した期間において、元本に対し支払われた手数料は以下のとおりある。

サブ・ファンド	通貨	証券貸付 総額	証券貸付の 取引相手方 による	証券貸付 利益純額
			費用および 手数料	
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・EUR	ユーロ	18,159.85	7,263.94	10,895.91
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・CHF	スイス・フラン	45,595.53	18,238.21	27,357.32
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD	米ドル	12,761.48	5,104.59	7,656.89
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・EUR	ユーロ	4,511.87	1,804.75	2,707.12
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・CHF	スイス・フラン	9,254.48	3,701.79	5,552.69
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD	米ドル	2,903.42	1,161.37	1,742.05
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・レディット・EUR	ユーロ	17,967.08	7,186.83	10,780.25
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・EUR	ユーロ	29,938.67	11,975.47	17,963.20
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・CHF	スイス・フラン	50,849.02	20,339.61	30,509.41
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD	米ドル	18,097.62	7,239.05	10,858.57

取引費用

取引費用には、（期間中に発生した場合）ブローカー手数料、印紙税、地方税およびその他の海外手数料が含まれる。取引手数料は、証券の売買費用に含まれる。

2020年9月30日に終了した期間において、ファンドは以下のとおり、投資証券の売買および類似の取引（デリバティブ商品またはその他の適格資産を含む）に関連する取引費用を負担した。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・EUR	186,640.73	ユーロ
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・CHF	283,163.68	スイス・フラン
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD	105,011.58	米ドル
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・EUR	61,030.08	ユーロ
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・CHF	65,880.79	スイス・フラン
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD	32,575.27	米ドル
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・EUR	228,061.88	ユーロ
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・CHF	314,188.88	スイス・フラン
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD	103,692.03	米ドル

すべての取引費用が個別に特定できるわけではない。確定利付証券、先物為替契約およびその他のデリバティブ契約の一部について、取引費用は投資対象の売買価格に含まれる。これらの取引費用は、個別には特定できないが、各サブ・ファンドのパフォーマンスの範囲内で把握される。

グローバル・エクスポージャー

グローバル・エクスポージャーは、各サブ・ファンドのコミットメント・アプローチに基づき計算される。

金融デリバティブ商品

サブ・ファンドは、効率的なポートフォリオ運用を目的としてデリバティブ取引を行うことができる。デリバティブの詳細は、注記のページに表示される。保有するデリバティブの種類によっては、取引相手方エクスポージャーを軽減するために、異なる取引相手方からの担保を受け入れることがある。その他の種類のデリバティブについて、証拠金勘定を使用する場合がある。

2020年9月30日現在、取引相手方リスクを軽減するために、ファンドが受け入れた担保はなかった。

新型コロナウイルス感染症（COVID - 19）

2019年の終わり以来、新型コロナウイルス感染症（COVID - 19）の流行は世界的にみられる。取締役会および投資運用会社は、ウイルスの拡大抑制に向けた各国政府の取り組みを注視し、我々のポートフォリオの投資への経済的影響（もしあれば）を監視し続けている。

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

CSインベストメント・ファンズ・12（2020年9月30日現在、無監査半期報告書）

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

投資有価証券明細表

国別内訳	
ルクセンブルグ	49.23
アメリカ合衆国	22.85
アイルランド	19.30
ドイツ	2.08
スイス	0.70
フランス	0.63
カナダ	0.48
イタリア	0.39
オーストラリア	0.38
スペイン	0.34
ノルウェー	0.32
オランダ	0.23
ベルギー	0.15
フィンランド	0.09
ポルトガル	0.08
ポーランド	0.08
オーストリア	0.06
スウェーデン	0.01
合計	97.40

業種別内訳	
投資信託／ファンド	67.18
国および中央政府	13.36
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	3.24
銀行・その他の金融機関	2.62
コンピューターハードウェア・ネットワーク	2.00
医薬品・化粧品・医療品	1.21
通信	0.99
国際機関	0.96
金融・投資・その他の多角化企業	0.73
小売り・百貨店	0.71
食品・清涼飲料	0.59
カントン（州）・連邦国家・プロビンス（州）	0.48
電子・半導体	0.43
宿泊・仕出し・娯楽施設	0.39
公共・非営利機関	0.38
各種消費財	0.35
建築材・建設業	0.35
自動車	0.31
繊維・衣服・革製品	0.20
交通・運輸	0.14
バイオテクノロジー	0.14
機械工学・産業機器	0.14
電気機器・部品	0.13
保険会社	0.11
化学	0.10
エネルギー・水道	0.07
石油	0.03
タバコ・アルコール飲料	0.01
グラフィック出版・印刷メディア	0.01
写真・光学	0.01
ヘルスケア・社会福祉	0.01
鉱業・石炭・鉄鋼	0.01
各種サービス	0.01
不動産	-
合計	97.40

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

投資有価証券明細表（続き）

投資有価証券明細表

銘柄	数量 / 額面	時価 （米ドル）	純資産 比率 （%）
証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：			
株式（およびエクイティ型証券）			
株式（およびエクイティ型証券）			
CHF ABB (reg. shares)	2,054	52,426.99	0.02
USD ABBVIE	6,096	533,948.64	0.16
USD ACCENTURE -A-	2,139	483,392.61	0.14
CHF ADECCO (reg. shares)	521	27,605.78	0.01
EUR ADIDAS (reg. shares)	140	45,327.61	0.01
USD ADOBE INC	1,533	751,829.19	0.22
EUR AEROPORTS DE PARIS	129	12,950.98	0.00
EUR AIR LIQUIDE	348	55,295.14	0.02
EUR AKZO NOBEL NV	266	26,953.55	0.01
CHF ALCON INC	437	24,876.82	0.01
EUR ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted)	457	87,629.02	0.03
USD ALPHABET -A-	1,997	2,926,803.20	0.87
EUR AMADEUS IT GROUP -A-	184	10,290.48	0.00
USD AMAZON.COM	725	2,282,829.25	0.68
USD AMGEN	1,892	480,870.72	0.14
USD APPLE	20,928	2,423,671.68	0.72
EUR ASML HOLDING	537	198,294.61	0.06
EUR AXA	2,650	49,015.95	0.01
CHF BALOISE-HOLDING (reg. shares)	177	26,105.03	0.01
EUR BANCO ESPIRITO SANTO (reg. shares)	9,506	0.01	0.00
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	4	407.52	0.00
EUR BASF (reg. shares)	1,276	77,794.12	0.02
EUR BMW	493	35,842.60	0.01
EUR BNP PARIBAS -A-	597	21,686.84	0.01
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	7,788	469,538.52	0.14
CHF CEMBRA MONEY (reg. shares)	159	18,933.29	0.01
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)	773	51,913.02	0.02
USD CISCO SYSTEMS	14,570	573,912.30	0.17
CHF CLARIANT (reg. shares)	826	16,327.04	0.00
USD COCA-COLA	13,498	666,396.26	0.20
EUR COVESTRO	265	13,154.88	0.00
EUR CRH PLC	579	20,959.63	0.01
CHF CS GROUP (reg. shares)	3,559	35,809.62	0.01
EUR DANONE	455	29,462.95	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES	96	17,983.76	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE (reg. shares)	140	24,592.82	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM (reg. shares)	1,590	26,636.51	0.01
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	1	899.61	0.00
EUR ENEL	5,996	52,157.51	0.02
EUR ESSLORLUXOTTICA	209	28,466.49	0.01
EUR EURONEXT NV	188	23,610.94	0.01
EUR FAURECIA	285	12,322.14	0.00
CHF FLUGHAFEN ZUERICH	11	1,515.79	0.00
EUR FRESENIUS	363	16,540.92	0.00
USD GAMING AND LEISURE PROPERTIES	13	487.64	0.00
CHF GEBERIT	37	21,980.97	0.01
CHF GIVAUDAN (reg. shares)	19	82,102.39	0.02
CHF GURIT-HEBERLEIN	4	8,524.80	0.00
EUR HELLOFRESH SE	285	15,899.13	0.00
USD HOME DEPOT	3,785	1,051,132.35	0.31
EUR IBERDROLA	10,514	129,576.55	0.04
CHF IDORSIA LTD	258	6,947.54	0.00
EUR INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL INDITEX	805	22,466.80	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOGIES (reg. shares)	1,126	31,848.54	0.01
EUR ING GROUP	6,149	43,677.49	0.01
USD INTEL	14,348	742,939.44	0.22
EUR INTESA SANPAOLO	12,193	22,919.89	0.01
USD JOHNSON & JOHNSON	9,021	1,343,046.48	0.40
CHF JULIUS BAER GRUPPE	27	1,154.08	0.00
EUR KERING	55	36,607.79	0.01
EUR KERRY GROUP -A-	82	10,591.28	0.00
EUR KONE -B-	192	16,872.50	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	1,678	49,672.45	0.01
EUR KONINKLIJKE DSM	127	20,939.07	0.01
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	6	1,170.96	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM (reg. shares)	1,117	51,051.76	0.02
CHF LANDIS+GYR GROUP AG	167	9,170.42	0.00
EUR LEGRAND	372	29,705.34	0.01
USD LINDE PLC	1,808	430,539.04	0.13
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	16,925.52	0.01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares)	418	32,612.64	0.01
CHF LONZA GROUP (reg. shares)	93	57,557.44	0.02
EUR L'OREAL	336	109,430.01	0.03
EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	138	64,424.28	0.02
USD MASTERCARD	2,904	982,045.68	0.29
USD MCDONALD'S	2,545	558,602.05	0.17
EUR MEDIOBANCA	3,876	30,446.01	0.01
USD MERCK & CO	8,725	723,738.75	0.22
USD MICROSOFT	23,300	4,900,688.99	1.45
EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT (reg. shares) (restricted)	105	26,669.58	0.01
EUR NESTE OYJ	444	23,424.53	0.01
CHF NESTLE (reg. shares)	4,542	540,552.49	0.16
USD NIKE -B-	4,266	535,553.64	0.16

銘柄	数量 / 額面	時価 （米ドル）	純資産 比率 （%）
CAD NORTHERN APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	251	6,773.27	0.00
CHF NOVARTIS (reg. shares)	3,605	313,558.14	0.09
USD NVIDIA	2,047	1,107,877.34	0.33
EUR ORANGE	1,471	15,324.61	0.00
CHF PARTNERS GROUP	48	44,283.70	0.01
USD PAYPAL HOLDINGS	5,117	1,008,202.51	0.30
USD PEPSICO	4,709	652,667.40	0.19
EUR PERNOD-RICARD	188	30,047.84	0.01
USD PROCTER & GAMBLE	8,519	1,184,055.81	0.35
EUR PROSUS NV	359	33,131.23	0.01
EUR PUMA	325	29,333.90	0.01
EUR RANDSTAD HOLDING	306	15,976.62	0.00
EUR RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA	425	21,818.76	0.01
EUR REPSOL	1,480	9,930.87	0.00
CHF ROCHE HOLDINGS (cert. shares)	1,136	389,679.28	0.12
EUR ROYAL DUTCH SHELL -A-	402	5,085.17	0.00
EUR ROYAL PHILIPS	674	31,772.72	0.01
EUR SAFRAN	238	23,614.36	0.01
USD SALESFORCE.COM	2,230	560,443.60	0.17
EUR SANOFI	429	42,877.18	0.01
EUR SAP SE	898	139,817.78	0.04
CHF SCHINDLER HOLDING	2	545.54	0.00
CHF SCHINDLER HOLDING (part. cert.)	5	1,368.74	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	407	50,614.33	0.02
CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES	8	11,180.64	0.00
CHF SFS GROUP (reg. shares)	21	2,117.76	0.00
EUR SIEMENS ENERGY AG	382	10,301.69	0.00
EUR SIEMENS (reg. shares)	765	96,768.37	0.03
CHF SIKA LTD	210	51,726.79	0.02
CHF SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares)	19	51,060.65	0.02
CHF SOFTWAREONE HOLDING AG	721	20,208.04	0.01
CHF SONOVA HOLDING (reg. shares)	76	19,324.05	0.01
CHF STADLER RAIL AG	147	6,128.13	0.00
EUR STMICROELECTRONICS	738	22,722.50	0.01
EUR STORA ENSO -R-	1,146	17,975.96	0.01
CHF STRAUMANN HOLDING (reg. shares)	1	1,012.27	0.00
CHF SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)	68	25,794.28	0.01
CHF SWISS PRIME SITE	139	12,648.32	0.00
CHF SWISS REINSURANCE	551	40,950.27	0.01
CHF SWISSCOM (reg. shares)	48	25,527.39	0.01
SEK TELEFON LM ERICSSON -B-	2,088	22,926.87	0.01
CHF TEMENOS GROUP	8	1,080.19	0.00
USD TESLA MOTORS	2,317	994,016.17	0.30
USD TEXAS INSTRUMENTS	3,149	449,645.71	0.13
CHF THE SWATCH GROUP	28	6,549.47	0.00
CHF THE SWATCH GROUP (reg. shares)	6	270.37	0.00
EUR TOTAL	1,821	62,353.55	0.02
CHF UBS GROUP	4,245	47,591.19	0.01
EUR UNICREDIT (reg. shares)	2,608	21,545.10	0.01
EUR UNILEVER	1,076	64,981.23	0.02
USD UNION PACIFIC	2,333	459,297.71	0.14
EUR VERBUND -A-	428	23,426.49	0.01
USD VERIZON COMMUNICATIONS	14,388	855,942.12	0.26
CHF VIFOR PHARMA AG	151	20,610.39	0.01
EUR VINCI	331	27,720.24	0.01
USD VISA -A-	5,638	1,127,430.86	0.34
EUR VOESTALPINE	574	15,153.02	0.00
USD WALT DISNEY	6,015	746,341.20	0.22
EUR WIENERBERGER	504	13,322.47	0.00
EUR WOLTERS KLUWER	201	17,168.58	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)	262	91,455.94	0.03

株式（およびエクイティ型証券）36,723,755.33 10.97

証券取引所または他の組織された市場に上場されている

証券：株式（およびエクイティ型証券）36,723,755.33 10.97

証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券

債券			
USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023	3,500,000	3,691,870.00	1.10
EUR AUSTRIA 0.75%/16-20.10.2026	130,000	164,908.36	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19- 22.10.2025	900,000	949,167.00	0.28
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-22.04.2033	170,000	235,056.17	0.07
EUR BELGIUM OLO S. -81- (reg. -S-) -144A- 0.8%/17-22.06.2027	100,000	127,652.33	0.04
EUR BELGIUM OLO S. -82- (reg. -S-) 0.5%/17- 22.10.2024	100,000	122,749.48	0.04
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-30.04.2030	100,000	120,787.64	0.04
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 0.6%/19-31.10.2029	100,000	122,181.92	0.04
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.4%/18-30.07.2028	100,000	129,931.97	0.04
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	1,023,000	848,040.53	0.25
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-15.02.2029	250,000	314,994.31	0.09
EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05%/17-	150,000	193,803.87	0.06

01.08.2027

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

投資有価証券明細表（続き）

銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2%/18-01.02.2028	150,000	193,715.92	0.06	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX)EQUITY PACIFIC	3,846	3,740,196.54	1.12
EUR CCTS EU FRN/15-15.12.2022	100,000	118,330.94	0.04	EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD			
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20- 13.02.2025	1,000,000	1,047,440.00	0.31	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA	5,069	3,633,477.93	1.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19- 09.10.2029	1,000,000	1,071,600.00	0.32	ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	344	875,311.49	0.26
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18- 13.06.2025	1,000,000	1,115,290.00	0.33	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -DB- EUR			
EUR FINNISH GOVERNMENT -144A- 0.5%/18- 15.09.2028	150,000	189,629.82	0.06	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -DB- USD	2,074	4,041,865.07	1.21
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-25.05.2028	250,000	319,948.76	0.10	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	5,212	6,616,869.54	1.98
EUR FRANCE OAT 0%/16-25.05.2022	200,000	237,081.69	0.07	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	16,160	2,769,546.01	0.83
EUR FRANCE OAT 0.5%/15-25.05.2025	300,000	370,155.18	0.11	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US	38,280	45,428,407.20	13.56
EUR FRANCE OAT 1.75%/13-25.05.2023	150,000	187,253.44	0.06	CORPORATE BOND FUND -EB- USD			
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-25.06.2039	150,000	229,876.92	0.07	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL	1,850	5,043,340.50	1.51
EUR GERMANY 0.25%/17-15.02.2027	170,000	212,049.13	0.06	HEALTH EQUITY FUND - EB- USD			
EUR GERMANY 0.5%/15-15.02.2025	200,000	247,480.75	0.07	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT	1,987	2,534,835.77	0.76
EUR GERMANY 1%/14-15.08.2024	100,000	125,300.00	0.04	EQUITY FUND - EBP USD- USD			
EUR GERMANY 1.5%/13-15.05.2023	100,000	124,207.09	0.04	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP	2,307	5,109,215.90	1.53
EUR IRELAND TREASURY BOND 1%/16-15.05.2026	100,000	127,123.47	0.04	SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF			
EUR ITALY BTP 0.95%/16-10.03.2023	150,000	180,472.59	0.05	USD CS INVESTMENT FUNDS 6 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB	13,625	1,854,907.50	0.55
EUR ITALY BTP 1.5%/15-01.06.2025	150,000	186,384.51	0.06	EQUITY FUND -EB-			
EUR ITALY BTP 1.65%/15-01.03.2032	150,000	189,246.36	0.06	USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	77,000	7,909,440.00	2.36
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	3,000,000	3,251,100.00	0.97	USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR	81,910	9,019,929.20	2.69
USD KFW 2%/17-29.09.2022	2,000,000	2,071,200.00	0.62	USD CSIF 2 - CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD	19,120	10,446,626.66	3.12
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901-2.125%/15- 11.02.2025	1,000,000	1,072,440.00	0.32	USD CSIF 3 - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	3,250	4,838,990.00	1.45
AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023	19,000	15,019.57	0.00				
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-15.07.2026	150,000	187,519.05	0.06	投資信託受益証券（オープン・エンド型）	224,976,037.12	67.18	
EUR OBRIGACOES DO TESOURO -144A-1.95%/19- 15.06.2029	100,000	135,845.64	0.04	証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：投資信託	224,976,037.12	67.18	
EUR OBRIGACOES DO TESOURO -144A-2.125%/18-17.10.2028	100,000	136,747.41	0.04	ポートフォリオ合計	326,165,728.67	97.40	
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	200,000	241,486.16	0.07	銀行預金およびブローカー預金	8,555,535.11	2.55	
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	932,000	760,170.10	0.23	銀行およびブローカーへの未払金	-12,747.88	/	
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	200,000	252,633.37	0.08	その他の純資産	160,386.79	0.05	
EUR SPAIN 0.4% 17-30.04.2022	250,000	297,416.29	0.09	純資産総額	334,868,902.69	100.00	
EUR SPAIN 1.6%/14-30.04.2025	100,000	127,525.69	0.04				
EUR SPAIN 2.75%/14-31.10.2024	100,000	132,177.59	0.04				
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11- 17.11.2026	1,063,000	986,074.78	0.29				
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	385,000	309,117.97	0.09				
USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023	3,500,000	3,653,671.88	1.09				
USD UNITED STATES S. -B-2025 2%/15-15.02.2025	3,500,000	3,767,695.33	1.13				
USD US S. C-2022 1.75%/12-15.05.2022	4,500,000	4,617,421.88	1.37				
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	3,500,000	3,790,117.21	1.13				
USD US S. F-2022 1.625%/12-15.11.2022	4,500,000	4,640,976.59	1.38				
USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021	3,500,000	3,570,410.17	1.07				
USD US TREASURY N/B S. -C-2029-2.375%/19-15.05.2029	3,000,000	3,450,937.50	1.03				
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-15.08.2028	3,500,000	4,132,187.50	1.22				
USD US 4.5%/06-15.02.2036	2,500,000	3,783,203.13	1.13				
USD US 4.625%/10-15.02.2040	2,000,000	3,222,031.26	0.96				
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19- 08.02.2029	2,000,000	2,367,080.00	0.71				

債券 64,465,936.22 19.25

証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券 64,465,936.22 19.25

証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：

投資信託

投資信託受益証券（オープン・エンド型）

USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD	374,570	46,671,422.00	13.93
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	8,237	7,982,836.15	2.38
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	8,135	8,267,681.85	2.47
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD	16,588	18,894,993.40	5.63
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	11,313	12,880,143.34	3.85
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN	7,056	7,472,954.84	2.23

ESG BLUE -QBX- JPY			
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	3,087	3,969,494.81	1.19
SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK			
ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP			

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

CSインベストメント・ファンズ・12（2020年9月30日現在、無監査半期報告書）

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

投資有価証券明細表

国別内訳	
ルクセンブルグ	46.68
アイルランド	23.03
アメリカ合衆国	21.42
ドイツ	2.40
スイス	0.84
ノルウェー	0.78
フランス	0.62
オーストラリア	0.59
オランダ	0.39
カナダ	0.29
スペイン	0.17
イタリア	0.15
ベルギー	0.08
ポーランド	0.04
ポルトガル	0.04
フィンランド	0.03
オーストリア	0.03
スウェーデン	0.01
合計	97.59

業種別内訳	
投資信託／ファンド	67.71
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	6.11
銀行・その他の金融機関	3.39
国および中央政府	3.37
コンピューターハードウェア・ネットワーク	2.97
医薬品・化粧品・医療品	2.12
国際機関	1.46
小売り・百貨店	1.35
金融・投資・その他の多角化企業	1.21
食品・清涼飲料	1.05
電子・半導体	0.85
宿泊・仕出し・娯楽施設	0.72
各種消費財	0.66
建築材・建設業	0.64
公共・非営利機関	0.59
自動車	0.58
通信	0.50
繊維・衣服・革製品	0.38
カントン（州）・連邦国家・プロビンス（州）	0.29
バイオテクノロジー	0.27
機械工学・産業機器	0.26
交通・運輸	0.26
電気機器・部品	0.20
化学	0.19
保険会社	0.18
エネルギー・水道	0.14
石油	0.06
鉱業・石炭・鉄鋼	0.02
写真・光学	0.02
グラフィック出版・印刷メディア	0.01
各種サービス	0.01
ヘルスケア・社会福祉	0.01
タバコ・アルコール飲料	0.01
不動産	-
合計	97.59

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

投資有価証券明細表（続き）

投資有価証券明細表

銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：				CHF NOVARTIS (reg. shares)	1,375	119,595.68	0.12
株式（およびエクイティ型証券）				USD NVIDIA	1,164	629,980.08	0.61
株式（およびエクイティ型証券）				CHF ORANGE	1,314	13,689.02	0.01
CHF ABB (reg. shares)	783	19,985.56	0.02	EUR PARTNERS GROUP	18	16,606.39	0.02
USD ABBVIE	3,465	303,499.35	0.30	USD PAYPAL HOLDINGS	2,909	573,160.27	0.56
USD ACCENTURE -A-	1,216	274,803.84	0.27	USD PEPSICO	2,677	371,032.20	0.36
CHF ADECCO (reg. shares)	199	10,544.24	0.01	EUR PERNOD-RICARD	92	14,641.83	0.01
EUR ADIDAS (reg. shares)	125	40,471.08	0.04	USD PROCTER & GAMBLE	4,842	672,989.58	0.66
USD ADOBE INC	871	427,164.53	0.42	EUR PROSUS NV	321	29,624.31	0.03
EUR AEROPORTS DE PARIS	63	6,310.81	0.01	EUR PUMA	159	14,293.94	0.01
EUR AIR LIQUIDE	311	49,416.06	0.05	EUR RANDSTAD HOLDING	149	7,785.15	0.01
EUR AKZO NOBEL NV	130	13,134.03	0.01	EUR RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA	207	10,631.93	0.01
CHF ALCON INC	166	9,449.77	0.01	EUR REPSOL	721	4,839.15	0.00
EUR ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted)	347	66,569.44	0.06	CHF ROCHE HOLDINGS (cert. shares)	433	148,530.92	0.14
USD ALPHABET -A-	1,135	1,663,455.99	1.63	EUR ROYAL DUTCH SHELL -A-	196	2,477.92	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP -A-	90	5,014.39	0.00	EUR ROYAL PHILIPS	602	28,378.60	0.03
USD AMAZON.COM	412	1,297,276.76	1.27	EUR SAFRAN	116	11,506.90	0.01
USD AMGEN	1,076	273,476.16	0.27	USD SALESFORCE.COM	1,268	318,673.76	0.31
USD APPLE	11,897	1,377,791.57	1.35	EUR SANOFI	209	20,893.36	0.02
EUR ASML HOLDING	389	143,670.15	0.14	EUR SAP SE	750	116,746.82	0.11
EUR AXA	1,867	34,541.10	0.03	CHF SCHINDLER HOLDING	1	272.77	0.00
CHF BALOISE-HOLDING (reg. shares)	68	10,029.05	0.01	CHF SCHINDLER HOLDING (part. cert.)	2	547.49	0.00
EUR BANCO ESPIRITO SANTO (reg. shares)	4,242	0.01	0.00	EUR SCHNEIDER ELECTRIC	364	45,266.87	0.04
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	1	101.88	0.00	CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES	3	4,192.74	0.00
EUR BASF (reg. shares)	897	54,676.90	0.05	CHF SFS GROUP (reg. shares)	8	806.77	0.00
EUR BMW	339	24,669.55	0.02	EUR SIEMENS ENERGY AG	300	8,096.51	0.01
EUR BNP PARIBAS -A-	291	10,567.65	0.01	EUR SIEMENS (reg. shares)	601	76,080.30	0.07
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	4,427	266,903.83	0.26	CHF SIKA LTD	80	19,705.44	0.02
CHF CEMBRA MONEY (reg. shares)	61	7,263.72	0.01	CHF SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares)	7	18,811.82	0.02
CHF CIE FINANCIERE RICHOMONT (reg. shares)	295	19,811.57	0.02	CHF SOFTWAREONE HOLDING AG	275	7,707.64	0.01
USD CISCO SYSTEMS	8,282	326,227.98	0.32	CHF SONOVA HOLDING (reg. shares)	29	7,373.65	0.01
CHF CLARIANT (reg. shares)	315	6,226.42	0.01	CHF STADLER RAIL AG	56	2,334.52	0.00
USD COCA-COLA	7,673	378,816.01	0.37	EUR STMICROELECTRONICS	360	11,072.31	0.01
EUR COVESTRO	129	6,410.16	0.01	EUR STORA ENSO -R-	558	8,759.39	0.01
EUR CRH PLC	518	18,751.45	0.02	CHF SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)	26	9,862.52	0.01
CHF CS GROUP (reg. shares)	1,357	13,653.74	0.01	CHF SWISS PRIME SITE	53	4,822.74	0.00
EUR DANONE	406	26,290.02	0.03	CHF SWISS REINSURANCE	210	15,607.18	0.02
EUR DASSAULT SYSTEMES	86	16,110.45	0.02	CHF SWISSCOM (reg. shares)	18	9,572.77	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE (reg. shares)	125	21,957.87	0.02	SEK TELEFON LM ERICSSON -B-	1,017	11,171.89	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM (reg. shares)	775	12,979.54	0.01	CHF TEMENOS GROUP	3	405.07	0.00
EUR ENEL	5,359	46,616.43	0.05	USD TESLA MOTORS	1,317	565,006.17	0.55
EUR ESSILORLUXOTTICA	187	25,470.02	0.02	USD TEXAS INSTRUMENTS	1,790	255,594.10	0.25
EUR EURONEXT NV	92	11,505.23	0.01	CHF THE SWATCH GROUP	11	2,573.01	0.00
EUR FAURECIA	139	6,004.38	0.01	CHF THE SWATCH GROUP (reg. shares)	2	90.12	0.00
CHF FLUGHAFEN ZUERICH	4	551.20	0.00	EUR TOTAL	1,627	55,710.73	0.05
EUR FRESENIUS	177	8,060.12	0.01	CHF UBS GROUP	1,619	18,150.80	0.02
USD GAMING AND LEISURE PROPERTIES	5	166.64	0.00	EUR UNICREDIT (reg. shares)	1,271	10,498.58	0.01
CHF GEBERIT	14	8,317.13	0.01	EUR UNILEVER	962	58,096.60	0.06
CHF GIVAUDAN (reg. shares)	7	30,248.25	0.03	USD UNION PACIFIC	1,326	261,049.62	0.25
CHF GURIT-HEBERLEIN	2	4,262.40	0.00	EUR VERBUND -A-	209	11,415.35	0.01
EUR HELLOFRESH SE	139	7,747.39	0.01	USD VERIZON COMMUNICATIONS	8,179	486,568.71	0.47
USD HOME DEPOT	2,152	597,631.92	0.58	CHF VIFOR PHARMA AG	58	7,916.57	0.01
EUR IBERDROLA	6,904	85,093.79	0.08	EUR VINCI	161	13,507.63	0.01
CHF IDORSIA LTD	99	2,665.92	0.00	USD VISA -A-	3,205	640,903.85	0.62
EUR INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL INDITEX	719	20,066.62	0.02	EUR VOESTALPINE	280	7,383.82	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOGIES (reg. shares)	549	15,519.28	0.02	USD WALT DISNEY	3,419	424,229.52	0.41
EUR ING GROUP	4,166	29,587.04	0.03	EUR WIENERBERGER	246	6,491.83	0.01
USD INTEL	8,156	422,317.68	0.41	EUR WOLTERS KLUWER	180	15,374.85	0.01
EUR INTESA SANPAOLO	10,896	20,481.85	0.02	CHF ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)	100	34,906.85	0.03
USD JOHNSON & JOHNSON	5,128	763,456.64	0.74	株式（およびエクイティ型証券）			20,777,271.86 20.23
CHF JULIUS BAER GRUPPE	10	427.44	0.00	証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：株式（およびエクイティ型証券）			20,777,271.86 20.23
EUR KERING	49	32,614.21	0.03	証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券			
EUR KERRY GROUP -A-	40	5,160.96	0.01	債券			
EUR KONE -B-	93	8,221.70	0.01	USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023	1,250,000	1,318,525.00	1.29
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	1,147	33,970.14	0.03	EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-22.04.2033	60,000	82,961.00	0.08
EUR KONINKLIJKE DSM	113	18,630.83	0.02	EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 0.6%/19-31.10.2029	30,000	36,654.58	0.04
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	2	390.32	0.00	CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17- 18.06.2027	27,000	22,382.30	0.02
CHF LAFARGEHOLCIM (reg. shares)	426	19,470.05	0.02	EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19- 15.02.2029	50,000	62,998.86	0.06
CHF LANDIS+GYR GROUP AG	64	3,514.41	0.00	EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2%/18-01.02.2028	40,000	51,657.58	0.05
EUR LEGRAND	181	14,474.94	0.01	USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	350,000	366,604.00	0.36
USD LINDE PLC	1,028	244,797.64	0.24	USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18- 13.06.2025	1,000,000	1,115,290.00	1.10
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	8,462.76	0.01	EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-25.05.2028	30,000	38,393.85	0.04
CHF LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares)	159	12,405.29	0.01	EUR FRANCE OAT 0.5%/15-25.05.2025	20,000	24,677.01	0.02
CHF LONZA GROUP (reg. shares)	35	21,661.40	0.02	EUR FRANCE OAT 1.75%/13-25.05.2023	30,000	37,460.69	0.04
EUR L'OREAL	239	77,690.04	0.08	EUR FRANCE OAT 1.75%/17-25.06.2039	30,000	45,975.39	0.04
EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	67	31,392.92	0.03	EUR KFW 0.01%/19-05.05.2027	50,000	60,665.29	0.06
USD MASTERCARD	1,651	558,318.67	0.54	USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	750,000	812,775.00	0.79
USD MCDONALD'S	1,447	317,602.03	0.31	USD KFW 2%/17-29.09.2022	1,000,000	1,035,600.00	1.02
EUR MEDIOBANCA	1,889	14,835.85	0.01				
USD MERCK & CO	4,960	411,432.00	0.40				
USD MICROSOFT	13,245	2,785,820.84	2.72				
EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT (reg. shares) (restricted)	94	23,875.62	0.02				
EUR NESTE OYJ	216	11,414.40	0.01				
CHF NESTLE (reg. shares)	1,732	206,128.78	0.20				
USD NIKE -B-	2,425	304,434.50	0.30				

CAD	NORTHERN APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	86	2,314.65	0.00	USD	KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15- 11.02.2025	750,000	804,330.00	0.78
-----	--	----	----------	------	-----	--	---------	------------	------

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

投資有価証券明細表（続き）

				純資産			
銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	比率 (%)	銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	比率 (%)
AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023	2,000	1,581.01	0.00	USD CSIF 2 - CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD	5,903	3,225,361.41	3.14
EUR OBRIGACOES DO TESOURO -144A-2.125%/18-17.10.2028	30,000	41,024.22	0.04	USD CSIF 3 - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	1,091	1,624,411.72	1.58
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	340,000	277,315.27	0.27				
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	35,000	44,210.84	0.04	投資信託受益証券（オープン・エンド型）69,550,722.65 67.71			
EUR SPAIN 0.4% 17-30.04.2022	30,000	35,689.95	0.03	証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：投資信託69,550,722.65 67.71			
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11- 17.11.2026	470,000	435,987.91	0.42	ポートフォリオ合計100,240,058.06 97.59			
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	215,000	172,624.32	0.17	銀行預金およびブローカー預金2,550,828.68 2.48			
USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023	300,000	313,171.88	0.30	銀行およびブローカーへの未払金-23,247.47 -0.02			
USD UNITED STATES S. -B-2025 2%/15-15.02.2025	300,000	322,945.31	0.31	その他の純負債-56,862.45 -0.05			
USD US S. C-2022 1.75%/12-15.05.2022	300,000	307,828.13	0.30	純資産総額102,710,776.82 100.00			
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	250,000	270,722.66	0.26				
USD US S. F-2022 1.625%/12-15.11.2022	300,000	309,398.44	0.30				
USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021	250,000	255,029.30	0.25				
USD US TREASURY N/B S. -C-2029-2.375%/19- 15.05.2029	250,000	287,578.13	0.28				
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-15.08.2028	250,000	295,156.25	0.29				
USD US 4.5%/06-15.02.2036	200,000	302,656.25	0.29				
USD US 4.625%/10-15.02.2040	200,000	322,203.13	0.31				
債券			9,912,063.55	9.65			
証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券			9,912,063.55	9.65			
証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：投資信託							
投資信託受益証券（オープン・エンド型）							
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD	132,653	16,528,563.80	16.08				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD-USD	1,266	1,227,392.94	1.19				
USD CREDIT SUISSSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	1,321	1,342,545.51	1.31				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD	8,031	9,148,119.49	8.90				
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	4,219	4,803,440.71	4.68				
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	2,840	3,007,821.96	2.93				
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	1,263	1,624,059.59	1.58				
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX)EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	1,590	1,546,259.10	1.51				
CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD	2,157	1,546,145.57	1.51				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -DB- EUR	339	864,058.97	0.84				
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -DB- USD	694	1,352,474.14	1.32				
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	817	1,036,688.07	1.01				
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	1,000	171,382.80	0.17				
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	4,268	5,065,006.32	4.92				
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	839	2,287,223.07	2.23				
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND - EBP USD- USD	1,125	1,435,173.75	1.40				
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND -EB- USD	1,003	2,220,521.52	2.16				
USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND -EB- USD	1,212	2,134,865.28	2.08				
CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	92	109,862.55	0.11				
USD CS INVESTMENT FUNDS 6 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND -EB-	4,897	666,677.58	0.65				

USD	CSIF	IE	FTSE	EPRA	NAREIT	DEVEL	-B	24,000	2,465,280.00	2.40	
USD-	EUR										
USD	CSIF	IE	MSCI	USA	SMALL	CAP	ESG	-B	37,390	4,117,386.80	4.01
USD-	EUR										

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

CSインベストメント・ファンズ・12（2020年9月30日現在、無監査半期報告書）

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

投資有価証券明細表

国別内訳	
ルクセンブルグ	47.03
アメリカ合衆国	30.57
アイルランド	13.47
ドイツ	2.50
フランス	0.96
スペイン	0.57
イタリア	0.55
カナダ	0.52
ノルウェー	0.45
スイス	0.44
オーストラリア	0.34
オランダ	0.29
ベルギー	0.23
フィンランド	0.14
オーストリア	0.13
ポルトガル	0.08
ポーランド	0.07
スウェーデン	0.02
合計	98.36

業種別内訳	
投資信託／ファンド	59.27
国および中央政府	25.65
銀行・その他の金融機関	3.21
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.93
通信	1.17
コンピューターハードウェア・ネットワーク	1.14
国際機関	0.90
医薬品・化粧品・医療品	0.80
金融・投資・その他の多角化企業	0.53
カントン（州）・連邦国家・プロビンス（州）	0.52
小売り・百貨店	0.43
食品・清涼飲料	0.37
公共・非営利機関	0.34
電子・半導体	0.31
宿泊・仕出し・娯楽施設	0.23
建築材・建設業	0.22
各種消費財	0.21
自動車	0.20
繊維・衣服・革製品	0.17
電気機器・部品	0.13
保険会社	0.10
機械工学・産業機器	0.09
交通・運輸	0.09
化学	0.09
エネルギー・水道	0.09
バイオテクノロジー	0.08
石油	0.04
タバコ・アルコール飲料	0.02
鉱業・石炭・鉄鋼	0.02
各種サービス	0.01
合計	98.36

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

投資有価証券明細表（続き）

投資有価証券明細表

純資産				純資産				
銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	比率 (%)	銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	比率 (%)	
証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券： 株式（およびエクイティ型証券）				株式（およびエクイティ型証券）				
株式（およびエクイティ型証券）				EUR PROSUS NV	143	13,197.12	0.00	
CHF ABB (reg. shares)	1,453	37,086.87	0.01	EUR PUMA	877	79,052.12	0.02	
USD ABBVIE	3,827	335,206.93	0.09	EUR RANDSTAD HOLDING	825	43,055.49	0.01	
USD ACCENTURE -A-	1,342	303,278.58	0.08	EUR RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E	1,146	58,799.52	0.02	
CHF ADECCO (reg. shares)	369	19,551.88	0.01	EUR REPSOL	3,989	26,762.77	0.01	
EUR ADIDAS (reg. shares)	56	18,131.05	0.01	CHF ROCHE HOLDINGS (cert. shares)	804	275,794.14	0.08	
USD ADOBE INC	962	471,793.66	0.13	EUR ROYAL DUTCH SHELL -A-	1,084	13,704.06	0.00	
EUR AEROPORTS DE PARIS	349	34,901.70	0.01	EUR ROYAL PHILIPS	269	12,680.80	0.00	
EUR AIR LIQUIDE	139	22,086.28	0.01	EUR SAFRAN	643	63,638.51	0.02	
EUR AKZO NOBEL NV	717	72,637.32	0.02	USD SALESFORCE.COM	1,400	351,848.00	0.10	
CHF ALCON INC	309	17,590.24	0.00	EUR SANOFI	1,155	115,550.01	0.03	
EUR ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted)	525	100,819.86	0.03	EUR SAP SE	655	101,959.21	0.03	
USD ALPHABET -A-	1,254	1,837,862.41	0.52	CHF SCHINDLER HOLDING	2	545.54	0.00	
EUR AMADEUS IT GROUP -A-	497	27,731.89	0.01	CHF SCHINDLER HOLDING (part. cert.)	3	821.24	0.00	
USD AMAZON.COM	456	1,435,820.88	0.41	EUR SCHNEIDER ELECTRIC	162	20,146.24	0.01	
USD AMGEN	1,187	301,687.92	0.08	CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES	6	8,385.48	0.00	
USD APPLE	13,134	1,521,048.54	0.44	CHF SFS GROUP (reg. shares)	15	1,512.68	0.00	
EUR ASML HOLDING	730	269,233.18	0.08	EUR SIEMENS ENERGY AG	384	10,358.57	0.00	
EUR AXA	3,885	71,869.83	0.02	EUR SIEMENS (reg. shares)	769	97,307.22	0.03	
CHF BALOISE-HOLDING (reg. shares)	125	18,435.76	0.01	CHF SIKA LTD	148	36,455.07	0.01	
EUR BANCO ESPIRITO SANTO (reg. shares)	3,799	0.00	0.00	CHF SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE	14	37,623.64	0.01	
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	3	305.64	0.00	HOLDING (reg. shares)				
EUR BASF (reg. shares)	1,885	114,897.30	0.03	CHF SOFTWAREONE HOLDING AG	510	14,294.17	0.00	
EUR BMW	768	55,844.11	0.02	CHF SONOVA HOLDING (reg. shares)	54	13,730.24	0.00	
EUR BNP PARIBAS -A-	1,609	58,444.00	0.02	CHF STADLER RAIL AG	104	4,335.55	0.00	
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	4,888	294,697.52	0.08	EUR STMICROELECTRONICS	1,989	61,235.03	0.02	
CHF CEMBRA MONEY (reg. shares)	113	13,455.74	0.00	EUR STORA ENSO -R-	3,089	48,443.53	0.01	
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)	547	36,735.35	0.01	CHF STRAUMANN HOLDING (reg. shares)	1	1,012.27	0.00	
USD CISCO SYSTEMS	9,143	360,142.77	0.10	CHF SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)	48	18,207.73	0.01	
CHF CLARIANT (reg. shares)	585	11,563.34	0.00	CHF SWISS PRIME SITE	98	8,917.52	0.00	
USD COCA-COLA	8,470	418,163.90	0.12	CHF SWISS REINSURANCE	390	28,984.77	0.01	
EUR COVESTRO	714	35,451.17	0.01	CHF SWISSCOM (reg. shares)	34	18,081.90	0.01	
EUR CRH PLC	231	8,362.13	0.00	SEK TELEFON LM ERICSSON -B-	5,627	61,785.78	0.02	
CHF CS GROUP (reg. shares)	2,519	25,345.44	0.01	CHF TEMENOS GROUP	6	810.14	0.00	
EUR DANONE	181	11,720.43	0.00	USD TESLA MOTORS	1,455	624,209.55	0.17	
EUR DASSAULT SYSTEMES	38	7,118.57	0.00	USD TEXAS INSTRUMENTS	1,976	282,153.04	0.08	
EUR DEUTSCHE BOERSE (reg. shares)	56	9,837.13	0.00	CHF THE SWATCH GROUP	20	4,678.19	0.00	
EUR DEUTSCHE TELEKOM (reg. shares)	4,284	71,782.91	0.02	CHF THE SWATCH GROUP (reg. shares)	4	180.25	0.00	
CHF EMS-CHEMIE HOLDING	1	899.61	0.00	EUR TOTAL	727	24,893.48	0.01	
EUR ENEL	2,395	20,833.43	0.01	CHF UBS GROUP	3,004	33,678.20	0.01	
EUR ESSILORLUXOTTICA	83	11,304.87	0.00	EUR UNICREDIT (reg. shares)	7,028	58,062.05	0.02	
EUR EURONEXT NV	508	63,629.29	0.02	EUR UNILEVER	430	25,968.33	0.01	
EUR FAURECIA	767	33,207.03	0.01	USD UNION PACIFIC	1,464	288,217.68	0.08	
CHF FLUGHAFEN ZUERICH	8	1,102.39	0.00	EUR VERBUND -A-	1,153	63,132.22	0.02	
EUR FRESENIUS	979	44,576.24	0.01	USD VERIZON COMMUNICATIONS	9,029	537,135.21	0.15	
USD GAMING AND LEISURE PROPERTIES	15	535.94	0.00	CHF VIFOR PHARMA AG	107	14,604.71	0.00	
CHF GEBERIT	26	15,446.09	0.00	EUR VINCI	891	74,703.47	0.02	
CHF GIVAUDAN (reg. shares)	14	60,496.50	0.02	USD VISA -A-	3,536	707,093.92	0.20	
CHF GURIT-HEBERLEIN	3	6,393.60	0.00	EUR VOESTALPINE	1,548	40,835.97	0.01	
EUR HELLOFRESH SE	768	42,846.68	0.01	USD WALT DISNEY	3,774	468,277.92	0.13	
USD HOME DEPOT	2,376	659,838.96	0.18	EUR WIENERBERGER	1,358	35,902.82	0.01	
EUR IBERDROLA	18,267	225,135.74	0.06	EUR WOLTERS KLUWER	80	6,833.27	0.00	
CHF IDORSIA LTD	183	4,927.91	0.00	CHF ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)	186	64,926.74	0.02	
EUR INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL INDITEX	321	8,958.81	0.00	株式（およびエクイティ型証券）			25,302,176.60	7.07
EUR INFINEON TECHNOLOGIES (reg. shares)	3,035	85,828.86	0.02	証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：株式（およびエクイティ型証券）			25,302,176.60	7.07
EUR ING GROUP	9,968	70,798.50	0.02	証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券				
USD INTEL	9,003	466,175.34	0.13	債券				
EUR INTESA SANPAOLO	4,870	9,154.42	0.00	USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023	2,000,000	2,109,640.00	0.59	
USD JOHNSON & JOHNSON	5,661	842,809.68	0.24	EUR AUSTRIA 0.75%/16-20.10.2026	250,000	317,131.47	0.09	
CHF JULIUS BAER GRUPPE	19	812.13	0.00	USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN	2,500,000	2,636,575.00	0.74	
EUR KERING	22	14,643.12	0.00	FRN/19- 22.10.2025				
EUR KERRY GROUP -A-	222	28,542.51	0.01	EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-	280,000	387,151.34	0.11	
EUR KONE -B-	517	45,469.81	0.01	22.04.2033				
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	2,659	78,742.66	0.02	EUR BELGIUM OLO S. -81- (reg. -S-)	200,000	255,304.67	0.07	
EUR KONINKLIJKE DSM	50	8,243.73	0.00	-144A- 0.8%/17-22.06.2027				
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	5	975.80	0.00	EUR BELGIUM OLO S. -82- (reg. -S-)	150,000	184,124.23	0.05	
CHF LAFARGEHOLCIM (reg. shares)	790	36,106.44	0.01	0.5%/17- 22.10.2024				
CHF LANDIS+GYR GROUP AG	118	6,479.70	0.00	EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/ 20- 30.04.2030	150,000	181,181.46	0.05	
EUR LEGRAND	1,001	80,053.14	0.02	EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A-	250,000	305,454.80	0.09	
USD LINDE PLC	1,135	270,277.55	0.08	0.6%/19-31.10.2029				
CHF LINDT & SPRUENGLI	1	8,462.76	0.00	EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A-	250,000	324,829.91	0.09	
CHF LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares)	296	23,094.12	0.01	1.4%/18-30.07.2028				
CHF LONZA GROUP (reg. shares)	66	40,847.22	0.01	CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/ 17- 18.06.2027	158,000	130,977.91	0.04	
EUR L'OREAL	480	156,372.90	0.04	EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/ 19- 15.02.2029	500,000	629,988.62	0.18	
EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	371	173,617.45	0.05	EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35%/ 19- 01.04.2030	250,000	308,392.29	0.09	
USD MASTERCARD	1,823	616,483.91	0.17	EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05%/17-	250,000	323,006.44	0.09	
USD MCDONALD'S	1,596	350,306.04	0.10	01.08.2027				
EUR MEDIOBANCA	10,446	82,049.17	0.02	EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2%/18-	250,000	322,859.86	0.09	
USD MERCK & CO	5,477	454,317.15	0.13	01.02.2028				
USD MICROSOFT	14,620	3,075,024.61	0.87	USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-	1,000,000	1,047,440.00	0.29	
EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-	42	10,667.83	0.00	13.02.2025				
GESELLSCHAFT (reg. shares)				USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/ 13.02.2025	1,000,000	1,071,600.00	0.30	
(restricted)								
EUR NESTE OYJ	1,197	63,126.93	0.02					
CHF NESTLE (reg. shares)	3,214	382,504.56	0.11					
USD NIKE -B-	2,676	335,945.04	0.09					
CAD NORTHERN APARTMENT REAL ESTATE	276	7,444.17	0.00					
INVESTMENT TRUST								
CHF NOVARTIS (reg. shares)	2,551	221,882.61	0.06					
USD NVIDIA	1,286	696,008.92	0.19					

クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイ(E34542)

訂正有価証券届出書（外国投資信託受益証券）

EUR	ORANGE	587	6,115.26	0.00	19-	09.10.2029				
CHF	PARTNERS GROUP	34	31,367.62	0.01	USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/	1,000,000	1,115,290.00	0.31	
USD	PAYPAL HOLDINGS	3,209	632,269.27	0.18	18-	13.06.2025				
USD	PEPSICO	2,956	409,701.60	0.11	EUR	FINNISH GOVERNMENT -144A- 0.5%/	270,000	341,333.67	0.10	
EUR	PERNOD-RICARD	507	80,976.14	0.02	18-	15.09.2028				
USD	PROCTER & GAMBLE	5,347	743,179.53	0.21						

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

投資有価証券明細表（続き）

銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	銘柄	数量 / 額面	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-25.05.2028	300,000	383,938.51	0.11	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX)EQUITY	2,125	2,066,541.25	0.58
EUR FRANCE OAT 0%/16-25.05.2022	400,000	474,163.37	0.13	PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE - QBX USD ACC- USD			
EUR FRANCE OAT 0.5%/15-25.05.2025	500,000	616,925.30	0.17	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA	2,761	1,979,095.00	0.55
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-25.05.2036	200,000	280,061.65	0.08	ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD			
EUR FRANCE OAT 1.75%/13-25.05.2023	250,000	312,089.07	0.09	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -DB- EUR	630	1,605,460.49	0.45
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-25.06.2039	200,000	306,502.57	0.09	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -DB- USD	2,540	4,949,657.80	1.38
EUR GERMANY 0.25%/17-15.02.2027	250,000	311,836.95	0.09	USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD	8,486	10,773,449.80	3.01
EUR GERMANY 0.5%/15-15.02.2025	250,000	309,350.93	0.09	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO CORPORATE BOND FUND -EB- EUR	29,200	5,004,377.69	1.40
EUR GERMANY 1%/14-15.08.2024	250,000	313,249.99	0.09	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND -EB- USD	50,000	59,337,000.00	16.58
EUR GERMANY 1.5%/13-15.05.2023	250,000	310,517.72	0.09	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	970	2,644,346.10	0.74
EUR IRELAND TREASURY BOND 1%/16-15.05.2026	100,000	127,123.47	0.04	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY FUND - EBP USD- USD	1,131	1,442,828.01	0.40
EUR ITALY BTP 0.95%/16-10.03.2023	250,000	300,787.66	0.08	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND -EB- USD	1,401	2,467,777.44	0.69
EUR ITALY BTP 1.5%/15-01.06.2025	250,000	310,640.85	0.09	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	150	179,123.72	0.05
EUR ITALY BTP 1.65%/15-01.03.2032	100,000	126,164.24	0.04	USD CS INVESTMENT FUNDS 6 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND -EB-	14,088	1,917,940.32	0.54
USD KfW 1.75%/19-14.09.2029	3,750,000	4,063,875.00	1.14	USD CSIF 1E FTSE EPRA NAREIT DEVEL - B USD- EUR	83,000	8,525,760.00	2.38
USD KfW 2%/17-29.09.2022	2,000,000	2,071,200.00	0.58	USD CSIF 1E MSCI USA SMALL CAP ESG - B USD- EUR	53,850	5,929,962.00	1.66
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901-2.125%/15- 11.02.2025	1,500,000	1,608,660.00	0.45	USD CSIF 2 - CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD	21,767	11,892,643.80	3.32
AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023	12,000	9,486.05	0.00	USD CSIF 3 - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	3,443	5,126,351.56	1.43
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-15.07.2026	250,000	312,531.75	0.09				
EUR OBRIGACOES DO TESOURO -144A-1.95%/19- 15.06.2029	100,000	135,845.64	0.04	投資信託受益証券（オープン・エンド型）	212,056,195.01	59.27	
EUR OBRIGACOES DO TESOURO -144A-2.125%/18-17.10.2028	100,000	136,747.41	0.04	証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：投資信託	212,056,195.01	59.27	
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	350,000	422,600.78	0.12	ポートフォリオ合計	351,902,826.40	98.36	
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	2,113,000	1,723,432.86	0.48	銀行預金およびブローカー預金	5,413,859.43	1.51	
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	200,000	252,633.37	0.07	その他の純資産	439,416.46	0.13	
EUR SPAIN 0.4% 17-30.04.2022	250,000	297,416.29	0.08	純資産総額	357,756,102.29	100.00	
EUR SPAIN 1.6%/14-30.04.2025	250,000	318,814.22	0.09				
EUR SPAIN 2.75%/14-31.10.2024	250,000	330,443.98	0.09				
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11- 17.11.2026	1,234,000	1,144,700.17	0.32				
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	96,000	77,078.77	0.02				
USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023	8,000,000	8,351,250.00	2.33				
USD UNITED STATES S. -B-2025 2%/15-15.02.2025	8,000,000	8,611,875.04	2.41				
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	8,000,000	8,663,125.04	2.42				
USD US S. F-2022 1.625%/12-15.11.2022	9,000,000	9,281,953.17	2.59				
USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021	8,000,000	8,160,937.52	2.28				
USD US TREASURY N/B S. -C-2029-2.375%/19- 15.05.2029	9,000,000	10,352,812.50	2.88				
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-15.08.2028	8,000,000	9,445,000.00	2.63				
USD US 4.5%/06-15.02.2036	6,000,000	9,079,687.50	2.54				
USD US 4.625%/10-15.02.2040	6,000,000	9,666,093.78	2.69				
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	3,000,000	3,550,620.00	0.99				
債券	114,544,454.79	32.02					
証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券	114,544,454.79	32.02					
証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：投資信託							

投資信託受益証券（オープン・エンド型）

USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (1E) ETF ICAV - CSIF (1) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD	264,609	32,970,281.40	9.22
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	14,420	13,976,237.14	3.91
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD	14,236	14,468,189.16	4.04
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD	8,559	9,749,163.44	2.73
EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	4,511	5,135,890.27	1.44
JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY	4,596	4,867,587.93	1.36
GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -QBX GBP ACC- GBP	1,794	2,306,858.98	0.64

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

4 管理会社の概況

（１）資本金の額

2020年10月末日現在、250,000スイス・フラン（約2,857万円）であり、発行済株式は500株である。

最近５年間における資本金の額の増減はない。

（注）スイス・フランの円貨換算は、2020年10月30日における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１スイス・フラン＝114.29円）による。以下同じ。

（２）事業の内容及び営業の状況

管理会社はファンドを自らの名義で運用することを承認されているが、ファンドの受益者の独占的利益のために受益者を代理して行うものとする。とりわけ、管理会社は、2010年法により認可される譲渡可能証券および他の資産の購入、売却、申込み、転換および受領について承認されている。

管理会社は現在の約款および英文目論見書に記載されるように2010年法の条項に従って、サブ・ファンドの投資方針を決定する。管理会社は、管理会社の取締役会のメンバーによって構成される投資委員会からはもちろん他の者からも投資に助言を求めることができる。管理会社は概して、ファンドの利益のために、情報、助言および他のサービスを用いることができる。

さらに、2010年法の条項に従い、管理会社はその責任において、一または複数の機能を第三者に委託し監督することができる。

2020年10月末日現在、管理会社は以下の投資ファンドを管理・運用している。

設立国	形態	ファンド数	純資産価額 (スイス・フラン)
ルクセンブルグ	ルクセンブルグ U C I T S	10 (106のサブ・ファンドを含む)	51,362,831,347.24
ルクセンブルグ	ルクセンブルグ U C I	2 (7のサブ・ファンドを含む)	7,375,872,337.18
ルクセンブルグ	ルクセンブルグ S I F	4 (13のサブ・ファンドを含む)	8,062,584,217.63

（３）その他

半期報告書提出前６か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えまたは与えると予想される事実はない。

[次へ](#)

（２）その他の訂正

訂正箇所を下線で示します。

第一部 証券情報

（４）発行（売出）価格

<訂正前>

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：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

クラスBH円建て（acc）受益証券：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

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：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

クラスBH円建て（acc）受益証券：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

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：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

クラスBH円建て（acc）受益証券：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

<訂正後>

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：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

クラスBH円建て（acc）受益証券：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

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：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

クラスBH円建て（acc）受益証券：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

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：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

クラスBH円建て（acc）受益証券：申込日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

（注１）2021年１月５日以降は、申込日の翌銀行営業日におけるクラス受益証券１口当たり純資産価格

（注２）銀行営業日とは、ルクセンブルグにおいて銀行が営業を行っている日をいう。

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

（４）その他の手数料等

<訂正前>

（前略）

g）約款およびファンドに関するその他の文書（ファンドまたは受益証券の募集に関連して必要となる、すべての政府当局および証券取引所（現地の証券業協会を含む。）に対する登録届出書、主要投資家情報文書、英文目論見書または約款を含む。）の作成、預託および発行に係る経費。あらゆる必要な言語による受益者向けの年次報告書および半期報告書の印刷および配布に係る経費、ならびに上記当局の関連する法律または規制により義務付けられたその他一切の報告書および文書の印刷および配布に係る経費。インデックス・プロバイダーに対するライセンス・フィー、管理会社が規制要件を満たすためのリスク管理システムの提供者またはかかるリスク管理システムに対するデータの提供者に対する報酬、帳簿の維持および日次純資産価額の計算に係る経費（年率0.10%を超えないものとする。）。受益者に対する公告（受益者に対する価格の公告を含む。）に係る経費。ファンドの監査人および法律顧問に係る報酬および経費、その他一切の類似する運営費用、な

らびに受益証券の募集および販売に関連して直接発生するその他の費用（ファンド受益証券の販売促進を行う際に使用される上記の文書または報告書の印刷に係る経費を含む。）。宣伝広告に係る経費も請求される場合がある。

すべての経常外費用は、まず、投資収益から控除され、その後は、証券取引によるキャピタル・ゲイン、ファンドの資産の順に控除される。サブ・ファンドまたは受益証券クラスの新設に係る経費などのその他の経常外費用は、5年を上限とする期間で償却することができる。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

g) 約款およびファンドに関するその他の文書（ファンドまたは受益証券の募集に関連して必要となる、すべての政府当局および証券取引所（現地の証券業協会を含む。）に対する登録届出書、主要投資家情報文書、英文目論見書または約款を含む。）の作成、預託および発行に係る経費。あらゆる必要な言語による受益者向けの年次報告書および半期報告書の印刷および配布に係る経費、ならびに上記当局の関連する法律または規制により義務付けられたその他一切の報告書および文書の印刷および配布に係る経費。取締役会の構成員の報酬ならびに合理的かつ文書化された範囲における旅費および実費と保険料（取締役／マネージャー保険を含む。）（特定のクラスの場合、これらの費用の全部または一部は管理会社が負担する場合がある。）。インデックス・プロバイダーに対するライセンス・フィー、管理会社が規制要件を満たすためのリスク管理システムの提供者またはかかるリスク管理システムに対するデータの提供者に対する報酬、帳簿の維持および日次純資産価額の計算に係る経費（年率0.10%を超えないものとする。）。受益者に対する公告（受益者に対する価格の公告を含む。）に係る経費。ファンドの監査人および法律顧問に係る報酬および経費、その他一切の類似する運営費用、ならびに受益証券の募集および販売に関連して直接発生するその他の費用（ファンド受益証券の販売促進を行う際に使用される上記の文書または報告書の印刷に係る経費を含む。）。宣伝広告に係る経費も請求される場合がある。

上記の手数料等の合計額については、投資者がファンドを保有する期間等に応じて異なるので、表示することができない。

すべての経常外費用は、まず、投資収益から控除され、その後は、証券取引によるキャピタル・ゲイン、ファンドの資産の順に控除される。サブ・ファンドまたは受益証券クラスの新設に係る経費などのその他の経常外費用は、5年を上限とする期間で償却することができる。

（後略）

第2 管理及び運営

1 申込（販売）手続等

（1）海外における申込（販売）手続等

<訂正前>

（前略）

英文目論見書に別段の定めがある場合を除き、申込み、買戻しおよび転換の申請は、ルクセンブルグにおいて銀行が営業を行っている評価日の1銀行営業日前の午後1時（中央欧州標準時）までに、中央管理事務代行会社または管理会社により受益証券の申込申請もしくは買戻申請を受け付ける権限を付与された販売会社に対して書面形式により提出しなければならない。

締切時間を過ぎて受領された申込み、買戻しおよび転換の申請は、翌銀行営業日の午後1時までに受領されたとみなされるものとする。

（後略）

<訂正後>

（前略）

英文目論見書に別段の定めがある場合を除き、申込み、買戻しおよび転換の申請は、ルクセンブルグにおいて銀行が営業を行っている評価日の1銀行営業日^{（注）}前の午後1時（中央欧州標準時）までに、中央管理事務代行会社または管理会社により受益証券の申込申請もしくは買戻申請を受け付ける権限を付与された販売会社に対して書面形式により提出しなければならない。

（注）2021年1月5日以降は、2銀行営業日。

締切時間を過ぎて受領された申込み、買戻しおよび転換の申請は、翌銀行営業日の午後1時までに受領されたとみなされるものとする。

（後略）

2 買戻し手続等

（1）海外における買戻し手続等

<訂正前>

（前略）

英文目論見書に別段の定めがある場合を除き、申込み、買戻しおよび転換の申請は、ルクセンブルグにおいて銀行が営業を行っている評価日の1銀行営業日前の午後1時（中央欧州標準時）までに、中央管理事務代行会社または管理会社により受益証券の申込申請もしくは買戻申請を受け付ける権限を付与された販売会社に対して書面形式により提出しなければならない。

締切時間を過ぎて受領された申込み、買戻しおよび転換の申請は、翌銀行営業日の午後1時までに受領されたとみなされるものとする。

（後略）

<訂正後>

（前略）

英文目論見書に別段の定めがある場合を除き、申込み、買戻しおよび転換の申請は、ルクセンブルグにおいて銀行が営業を行っている評価日の1銀行営業日^{（注）}前の午後1時（中央欧州標準時）までに、中央管理事務代行会社または管理会社により受益証券の申込申請もしくは買戻申請を受け付ける権限を付与された販売会社に対して書面形式により提出しなければならない。

（注）2021年1月5日以降は、2銀行営業日。

締切時間を過ぎて受領された申込み、買戻しおよび転換の申請は、翌銀行営業日の午後１時までに受領されたとみなされるものとする。

（後略）

（３）受益証券の転換

<訂正前>

（前略）

英文目論見書に別段の定めがある場合を除き、申込み、買戻しおよび転換の申請は、ルクセンブルグにおいて銀行が営業を行っている評価日の１銀行営業日前の午後１時（中央欧州標準時）までに、中央管理事務代行会社または管理会社により受益証券の申込申請もしくは買戻申請を受け付ける権限を付与された販売会社に対して書面形式により提出しなければならない。

締切時間を過ぎて受領された申込み、買戻しおよび転換の申請は、翌銀行営業日の午後１時までに受領されたとみなされるものとする。

<訂正後>

（前略）

英文目論見書に別段の定めがある場合を除き、申込み、買戻しおよび転換の申請は、ルクセンブルグにおいて銀行が営業を行っている評価日の１銀行営業日^{（注）}前の午後１時（中央欧州標準時）までに、中央管理事務代行会社または管理会社により受益証券の申込申請もしくは買戻申請を受け付ける権限を付与された販売会社に対して書面形式により提出しなければならない。

（注）2021年１月５日以降は、２銀行営業日。

締切時間を過ぎて受領された申込み、買戻しおよび転換の申請は、翌銀行営業日の午後１時までに受領されたとみなされるものとする。