

【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3年12月24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 ルドルフ・コーメン
(Rudolf Kömen, 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
(109,490,000,000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
(109,490,000,000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
(109,490,000,000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、2021年7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=109.49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3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、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】

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

（2021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	202,455,943	46.70
	アイルランド	74,644,548	17.22
	アメリカ合衆国	25,844,909	5.96
	スイス	1,802,906	0.42
	フランス	200,427	0.05
	ドイツ	183,690	0.04
	オランダ	173,944	0.04
	スペイン	57,511	0.01
	イタリア	33,905	0.01
	フィンランド	8,365	0.00
	小計	305,406,148	70.45
確定利付証券	アメリカ合衆国	78,828,291	18.18
	国際機関	13,027,985	3.01
	ドイツ	8,350,780	1.93
	オランダ	4,780,492	1.10
	オーストラリア	4,376,104	1.01
	メキシコ	2,836,650	0.65
	ノルウェー	2,607,175	0.60
	カナダ	1,968,713	0.45
	フランス	1,202,299	0.28
	スペイン	1,112,110	0.26
	イタリア	1,001,158	0.23
	ルクセンブルグ	410,177	0.09
	ベルギー	360,150	0.08
	フィンランド	325,615	0.08
	オーストリア	304,637	0.07
	ポーランド	242,236	0.06
	ボルトガル	130,921	0.03
	アイルランド	122,317	0.03

	小計	121,987,810	28.14
小計		427,393,958	98.59
現金およびその他の資産（負債控除後）		6,127,381	1.41
合計 （純資産総額）		433,521,339 （約49,278百万円）	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、2021年10月29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＝113.67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

（2021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	209,243,207	45.87
	アイルランド	111,334,350	24.41
	アメリカ合衆国	41,162,173	9.02
	スイス	2,571,370	0.56
	フランス	503,703	0.11
	ドイツ	459,473	0.10
	オランダ	436,112	0.10
	スペイン	147,476	0.03
	イタリア	84,886	0.02
	フィンランド	22,307	0.00
	小計	365,965,056	80.23
確定利付証券	アメリカ合衆国	54,923,219	12.04
	ドイツ	5,614,428	1.23
	国際機関	4,199,900	0.92
	オランダ	3,540,181	0.78
	オーストラリア	3,395,303	0.74
	メキシコ	2,363,875	0.52
	カナダ	1,684,049	0.37
	ノルウェイ	1,054,111	0.23
	フランス	747,089	0.16
	イタリア	724,816	0.16
	スペイン	491,493	0.11
	ベルギー	340,949	0.07
	ポルトガル	262,754	0.06
	ポーランド	242,236	0.05
	ルクセンブルグ	234,387	0.05
	フィンランド	180,897	0.04
	オーストリア	158,411	0.03
	ガーンジー	1,206	0.00
	小計	80,159,305	17.57
小計		446,124,361	97.80
現金およびその他の資産（負債控除後）		10,021,469	2.20
合計 （純資産総額）		456,145,830 （約51,850百万円）	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

（2021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	77,288,436	39.21
	アイルランド	58,333,069	29.59
	アメリカ合衆国	38,076,681	19.32
	スイス	1,707,652	0.87
	フランス	449,963	0.23
	ドイツ	410,861	0.21
	オランダ	389,905	0.20
	スペイン	137,735	0.07
	イタリア	75,863	0.04
	フィンランド	15,615	0.01
	小計	176,885,779	89.74
確定利付証券	アメリカ合衆国	8,043,744	4.08
	国際機関	1,597,175	0.81
	ドイツ	1,268,420	0.64
	オーストラリア	1,133,293	0.57
	オランダ	839,858	0.43
	ノルウェイ	780,886	0.40
	カナダ	313,265	0.16
	メキシコ	236,388	0.12
	イタリア	115,430	0.06
	ベルギー	77,175	0.04
	ポーランド	42,391	0.02
	フランス	41,964	0.02
	小計	14,489,986	7.35
小計		191,375,766	97.09
現金およびその他の資産（負債控除後）		5,738,347	2.91
合計 （純資産総額）		197,114,113 （約22,406百万円）	100.00

(2) 運用実績

純資産の推移

2021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
2020年11月末日	370,478,155.17	42,112,251,898	300.19	34,123	10,753
12月末日	379,710,131.42	43,161,650,639	305.83	34,764	10,945
2021年1月末日	387,471,607.50	44,043,897,625	306.03	34,786	10,945
2月末日	384,963,078.11	43,758,753,089	306.30	34,817	10,953
3月末日	395,362,518.61	44,940,857,490	305.91	34,773	10,931
4月末日	408,607,466.64	46,446,410,733	312.28	35,497	11,154
5月末日	408,015,568.34	46,379,129,653	314.12	35,706	11,212
6月末日	419,212,402.97	47,651,873,846	316.79	36,010	11,305
7月末日	447,475,428.49	50,864,531,956	319.23	36,287	11,388
8月末日	440,692,606.32	50,093,528,560	321.53	36,548	11,467
9月末日	427,425,826.56	48,585,493,705	315.67	35,882	11,253
10月末日	433,521,339.42	49,278,370,652	320.78	36,463	11,434

(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 円
			米ドル	円	
2020年11月末日	348,898,693.41	39,659,314,480	320.50	36,431	11,135
12月末日	362,578,584.91	41,214,307,747	329.20	37,420	11,426
2021年1月末日	368,346,431.90	41,869,938,914	330.81	37,603	11,478
2月末日	372,538,631.16	42,346,466,204	333.33	37,890	11,561
3月末日	378,870,913.07	43,066,256,689	334.11	37,978	11,580
4月末日	392,710,205.35	44,639,369,042	343.57	39,054	11,902
5月末日	409,318,427.83	46,527,225,691	345.62	39,287	11,966
6月末日	417,148,061.40	47,417,220,139	349.51	39,729	12,098
7月末日	427,277,640.75	48,568,649,424	351.87	39,997	12,176
8月末日	435,786,529.69	49,535,854,830	356.17	40,486	12,321
9月末日	437,907,356.03	49,776,929,160	347.60	39,512	12,020
10月末日	456,145,830.11	51,850,096,509	356.85	40,563	12,340

（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 円
			米ドル	円	
2020年11月末日	107,995,370.04	12,275,833,712	311.29	35,384	11,217
12月末日	112,507,801.10	12,788,761,751	322.75	36,687	11,619
2021年1月末日	107,847,068.90	12,258,976,322	325.64	37,015	11,718
2月末日	113,757,786.01	12,930,847,536	329.82	37,491	11,862
3月末日	118,103,374.30	13,424,810,557	332.58	37,804	11,953
4月末日	127,437,273.10	14,485,794,833	344.54	39,164	12,374
5月末日	132,467,824.83	15,057,617,648	346.71	39,411	12,447
6月末日	135,319,406.31	15,381,756,915	351.70	39,978	12,623
7月末日	166,946,928.62	18,976,857,376	354.09	40,249	12,705
8月末日	171,594,685.48	19,505,167,899	360.27	40,952	12,923
9月末日	172,438,661.13	19,601,102,611	348.79	39,647	12,506
10月末日	197,114,113.78	22,405,961,313	363.44	41,312	13,031

（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

2021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

2021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
2020年11月1日～ 2021年10月末日	11.89%	11.30%

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
2020年11月1日～ 2021年10月末日	18.98%	18.39%

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
2020年11月1日～ 2021年10月末日	27.28%	26.63%

（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
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	7.98%	6.61%
2021年	13.25%	11.38%

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
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	10.13%	8.69%
2021年	8.40%	8.00%

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

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
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	11.57%	10.16%
2021年	25.64%	23.55%

（注２）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝暦年末（2021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（2021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

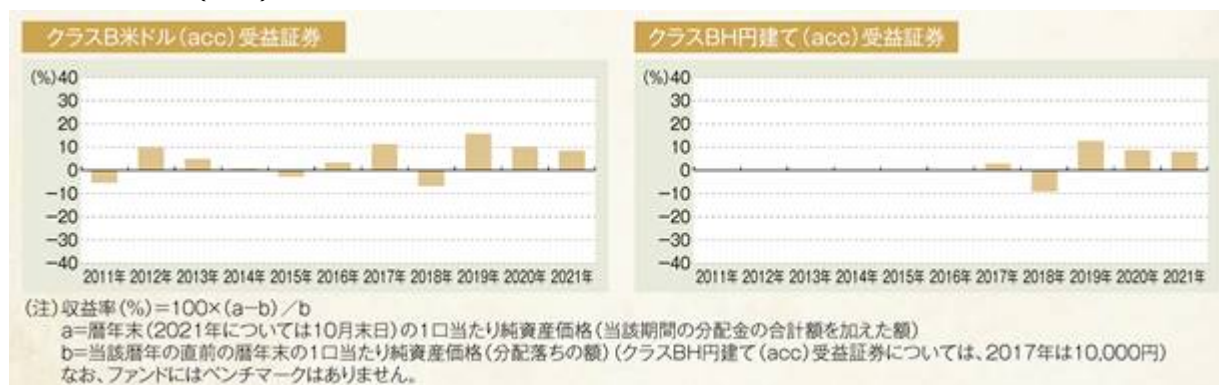


収益率の推移（暦年ベース）

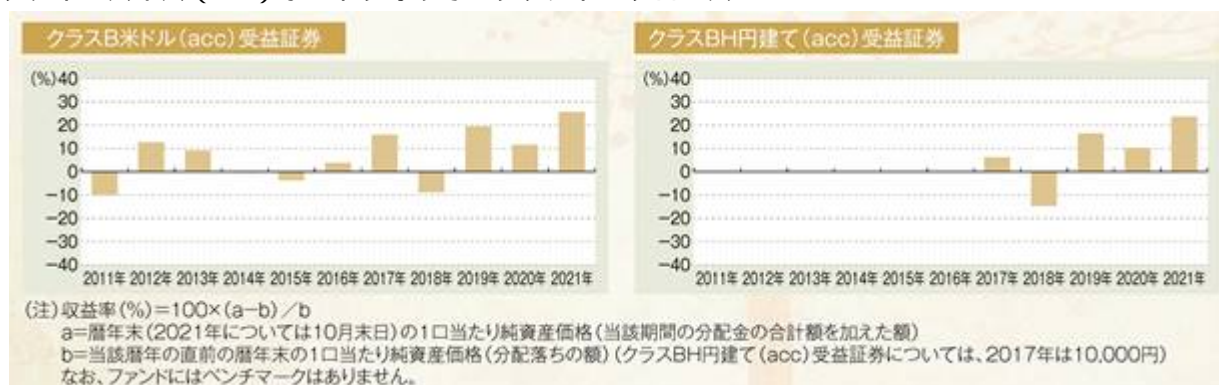
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD



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

2021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2021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
2020年11月1日～	198,130	150,173	828,731
2021年10月末日	(102,811)	(62,952)	(194,140)

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
2020年11月1日～	113,494	10,364	135,582
2021年10月末日	(113,494)	(10,364)	(135,582)

（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
2020年11月1日～	178,072	56,175	774,617
2021年10月末日	(91,829)	(12,147)	(394,361)

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
2020年11月1日～	207,046	32,861	327,966
2021年10月末日	(204,667)	(32,661)	(325,587)

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
2020年11月1日～	152,970	40,050	381,070
2021年10月末日	(132,320)	(28,219)	(152,784)

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
2020年11月1日～	208,143	2,951	243,211
2021年10月末日	(205,624)	(2,951)	(240,562)

[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、2021年10月29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＝124.73円、1米ドル＝113.67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）

	2021年9月30日現在	
	（スイス・フラン）	（千円）
資産		
投資証券 - 時価	4,860,335,554.49	606,229,654
銀行預金およびブローカー預金	50,766,013.05	6,332,045
未収収益	4,787,496.80	597,144
先物為替契約に係る未実現純利益	119,181.83	14,866
	4,916,008,246.17	613,173,709
負債		
未払利息	491.48	61
未払費用引当金	6,192,956.58	772,447
先物為替契約に係る未実現純損失	26,422,009.89	3,295,617
その他の負債	748.58	93
	32,616,206.53	4,068,219
純資産	4,883,392,039.64	609,105,489

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）

2021年4月1日から
2021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	4,758,903,687.16	593,578,057
収益		
投資証券に係る利息（純額）	7,565,286.83	943,618
配当金（純額）	5,688,085.68	709,475
銀行利息	402.55	50
証券貸付収益	64,796.34	8,082
その他の収益	1,082,110.66	134,972
	14,400,682.06	1,796,197
費用		
管理報酬	31,817,273.13	3,968,568
保管報酬	1,521,086.51	189,725
管理事務代行費用	1,461,001.87	182,231
印刷および公告費	22,975.18	2,866
利息および銀行手数料	91,585.84	11,424
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	467,499.11	58,311
年次税	555,598.84	69,300
	35,937,020.48	4,482,425
純利益（損失）	(21,536,338.42)	(2,686,227)
実現利益（損失）		
投資対象売却	40,247,099.55	5,020,021
先物為替契約	(14,258,958.88)	(1,778,520)
外国為替	1,174,658.51	146,515
	27,162,799.18	3,388,016
実現純利益（損失）	5,626,460.76	701,788
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	114,006,241.66	14,219,999
先物為替契約	9,451,258.80	1,178,856
	123,457,500.46	15,398,854
運用の結果による純資産の純増加（減少）	129,083,961.22	16,100,642
申込み / 買戻し		
申込み	385,445,276.80	48,076,589
買戻し	(351,250,264.64)	(43,811,446)
	34,195,012.16	4,265,144

分配金	(457.22)	(57)
為替換算調整	(38,790,163.68)	(4,838,297)
期末現在純資産	4,883,392,039.64	609,105,489

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%	1.93%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	28145643	LU1230136977	0.60%	1.01%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	1057436	LU0108835801	0.60%	1.02%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	26362734	LU1144411391	1.25%	1.68%
クラスBH円建て（acc）	36829019	LU1614284856	1.50%	2.00%

ファンド・パフォーマンス

	年初来	設定来	2020年	2019年	2018年
クラスB米ドル（acc）	5.59%	/	10.13%	15.75%	- 6.79%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	6.32%	/	11.14%	16.79%	- 6.01%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	6.30%	/	11.12%	16.75%	- 6.00%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	5.79%	/	10.40%	16.03%	- 6.57%
クラスBH円建て（acc）	5.20%	/	8.70%	12.60%	- 9.20%

注記

先物為替契約

買い		売り		満期日 (日 - 月 - 年)	評価額 (米ドル)
取引相手方					
日本円	50,250,500	米ドル	- 456,336	12.10.2021	- 5,926.76
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	1,168,121,400	米ドル	- 10,559,528	12.10.2021	- 89,327.85
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	74,892,800	米ドル	- 681,327	12.10.2021	- 10,042.17
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
米ドル	9,218,980	ユーロ	- 7,795,630	09.11.2021	177,350.58
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	139,597,000	米ドル	- 1,270,221	09.11.2021	- 18,732.95
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
米ドル	1,087,132	カナダ・ドル	- 1,360,000	09.11.2021	13,692.12
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
日本円	1,103,417,200	米ドル	- 10,054,673	09.11.2021	- 162,532.67
Citibank N.A.- London - United Kingdom					
日本円	1,243,014,200	米ドル	- 11,312,913	09.12.2021	- 165,940.75
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
先物為替契約に係る未実現純損失					- 261,460.45

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

	2021年 9 月30日現在	
	（米ドル）	（千円）
資産		
投資証券 - 時価	427,642,262.36	48,610,096
銀行預金およびブローカー預金	10,644,888.47	1,210,004
未収収益	438,477.93	49,842
	438,725,628.76	49,869,942
負債		
未払利息	8.77	1
未払費用引当金	556,801.78	63,292
先物為替契約に係る未実現純損失	261,460.45	29,720
	818,271.00	93,013
純資産	437,907,357.76	49,776,929

ファンドの推移	2021年 9 月30日現在	2021年 3 月31日現在	2020年 3 月31日現在
純資産総額（米ドル）	437,907,357.76	378,870,913.07	287,121,088.45

1口当たり純資産価格			
クラスB米ドル（acc）	347.60	334.11	263.06
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	1,458.20	1,395.17	1,088.44
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	1,585.47	1,517.11	1,183.80
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	142.12	136.43	107.15
クラスBH円建て（acc）	12,020.00	11,580.00	9,197.00

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）	762,232.071	684,695.650	107,363.317	29,826.896
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	13,051.168	14,688.364	696.419	2,333.615
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	39,985.548	32,550.799	7,434.749	0.000
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	402,793.578	424,058.484	28,545.029	49,809.935
クラスBH円建て（acc）	308,974.124	213,492.621	128,342.587	32,861.084

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）

2021年4月1日から
2021年9月30日までの期間
（米ドル）（千円）

期首現在純資産	378,870,913.07	43,066,257
収益		
投資証券に係る利息（純額）	899,804.27	102,281
配当金（純額）	216,875.28	24,652
銀行利息	0.87	0
証券貸付収益	1,447.26	165
その他の収益	66,161.01	7,521
	1,184,288.69	134,618
費用		
管理報酬	2,712,961.32	308,382
保管報酬	130,342.05	14,816
管理事務代行費用	125,128.47	14,223
印刷および公告費	2,927.20	333
利息および銀行手数料	386.93	44
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	69,510.46	7,901
年次税	55,942.36	6,359
	3,097,198.79	352,059
純利益（損失）	(1,912,910.10)	(217,440)
実現利益（損失）		
投資対象売却	2,158,891.92	245,401
先物為替契約	(602,309.58)	(68,465)
外国為替	(47,979.78)	(5,454)
	1,508,602.56	171,483
実現純利益（損失）	(404,307.54)	(45,958)
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	15,026,173.85	1,708,025
先物為替契約	437,355.37	49,714
	15,463,529.22	1,757,739
運用の結果による純資産の純増加（減少）	15,059,221.68	1,711,782
申込み / 買戻し		
申込み	68,475,100.53	7,783,565

買戻し	(24,497,877.52)	(2,784,674)
	43,977,223.01	4,998,891
期末現在純資産	437,907,357.76	49,776,929

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%	2.14%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	28146665	LU1230137272	0.60%	1.02%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	26362879	LU1144411631	1.40%	1.85%
クラスBH円建て（acc）	36829025	LU1614285234	1.70%	2.22%

ファンド・パフォーマンス

	年初来	設定来	2020年	2019年	2018年
クラスB米ドル（acc）	8.07%	/	11.57%	19.45%	- 8.84%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	8.98%	/	12.83%	20.76%	- 7.93%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	8.31%	/	11.91%	19.79%	- 8.58%
クラスBH円建て（acc）	7.63%	/	10.16%	16.43%	- 14.64%

注記

先物為替契約

買い		売り		満期日 (日 - 月 - 年)	評価額 (米ドル)
取引相手方					
日本円	30,446,500	米ドル	- 272,085	12.10.2021	815.55
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	200,958,600	米ドル	- 1,803,589	12.10.2021	- 2,340.20
Citibank N.A.- London - United Kingdom					
日本円	301,827,000	米ドル	- 2,728,441	12.10.2021	- 23,081.13
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
米ドル	286,577	日本円	- 31,979,500	12.10.2021	- 64.70
JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom					
日本円	9,817,700	米ドル	- 89,108	12.10.2021	- 1,109.31
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	10,818,000	米ドル	- 98,556	12.10.2021	- 1,591.66
Citibank N.A.- London - United Kingdom					
日本円	395,864,400	米ドル	- 3,605,201	12.10.2021	- 56,957.09
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	9,919,900	米ドル	- 90,245	12.10.2021	- 1,330.13
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
米ドル	982,289	ユーロ	- 830,630	09.11.2021	18,896.83
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	9,919,900	米ドル	- 90,263	09.11.2021	- 1,331.18
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
日本円	312,645,000	米ドル	- 2,848,916	09.11.2021	- 46,052.42
Citibank N.A.- London - United Kingdom					
日本円	322,564,900	米ドル	- 2,935,726	09.12.2021	- 43,061.99
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
先物為替契約に係る未実現純損失					- 157,207.43

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

	2021年 9 月30日現在	
	（米ドル）	（千円）
資産		
投資証券 - 時価	169,134,930.36	19,225,568
銀行預金およびブローカー預金	3,634,292.04	413,110
未収収益	90,430.27	10,279
	172,859,652.67	19,648,957
負債		
未払利息	2.48	0
未払費用引当金	262,981.10	29,893
先物為替契約に係る未実現純損失	157,207.43	17,870
その他の負債	802.48	91
	420,993.49	47,854
純資産	172,438,659.18	19,601,102

ファンドの推移	2021年 9 月30日現在	2021年 3 月31日現在	2020年 3 月31日現在
純資産総額（米ドル）	172,438,659.18	118,103,374.30	86,710,192.70

1口当たり純資産価格			
クラスB米ドル（acc）	348.79	332.58	241.43
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	1,579.99	1,498.08	1,075.41
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	155.63	148.17	107.24
クラスBH円建て（acc）	12,506.00	11,953.00	8,749.00

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）	376,614.764	258,650.331	124,629.981	6,665.548
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	6,391.132	6,994.646	775.441	1,378.955
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	108,582.705	98,314.880	12,737.279	2,469.454
クラスBH円建て（acc）	125,633.233	65,042.951	63,540.820	2,950.538

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）

2021年4月1日から
2021年9月30日までの期間
(米ドル) (千円)

期首現在純資産	118,103,374.30	13,424,811
収益		
投資証券に係る利息（純額）	157,055.01	17,852
配当金（純額）	134,985.58	15,344
銀行利息	22.83	3
証券貸付収益	127.51	14
その他の収益	12,602.55	1,433
	304,793.48	34,646
費用		
管理報酬	1,163,783.02	132,287
保管報酬	45,773.90	5,203
管理事務代行費用	43,943.45	4,995
印刷および公告費	2,255.74	256
利息および銀行手数料	163.49	19
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	39,192.75	4,455
年次税	20,718.26	2,355
	1,315,830.61	149,570
純利益（損失）	(1,011,037.13)	(114,925)
実現利益（損失）		
投資対象売却	797,844.65	90,691
先物為替契約	(182,167.12)	(20,707)
外国為替	(10,816.39)	(1,229)
	604,861.14	68,755
実現純利益（損失）	(406,175.99)	(46,170)
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	5,710,103.02	649,067
先物為替契約	76,132.58	8,654
	5,786,235.60	657,721

運用の結果による純資産の純増加（減少）	5,380,059.61	611,551
申込み／買戻し		
申込み	54,190,639.18	6,159,850
買戻し	(5,235,413.91)	(595,109)
	48,955,225.27	5,564,740
期末現在純資産	172,438,659.18	19,601,102

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%	1.72%
クラスB米ドル（acc）	672337	LU0078046959	1.30%	1.73%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	28145654	LU1230137199	0.60%	1.01%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	28234308	LU1230137439	0.60%	1.03%
クラスUA - 分配型（米ドル）	26362951	LU1144412100	1.05%	1.47%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	26364579	LU1144412282	1.05%	1.47%
クラスBH円建て（acc）	36829010	LU1614284344	1.30%	1.80%

ファンド・パフォーマンス

	年初来	設定来	2020年	2019年	2018年
クラスA - 分配型（米ドル）	3.22%	/	7.98%	12.26%	- 4.83%
クラスB米ドル（acc）	3.22%	/	7.98%	12.26%	- 4.83%
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	3.78%	/	8.76%	13.05%	- 4.17%
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	3.76%	/	8.73%	13.01%	- 4.21%
クラスUA - 分配型（米ドル）	3.41%	/	8.25%	12.52%	- 4.60%
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	3.41%	/	8.25%	12.53%	- 4.61%
クラスBH円建て（acc）	2.81%	/	6.61%	9.14%	- 7.29%

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	4,223,500	米ドル	- 38,478	12.10.2021	- 621.40
Citibank N.A.- London - United Kingdom					
日本円	521,625,700	米ドル	- 4,715,367	12.10.2021	- 39,889.44
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	9,979,100	米ドル	- 91,023	12.10.2021	- 1,577.21
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
日本円	7,383,200	米ドル	- 67,168	12.10.2021	- 989.99
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
日本円	7,383,200	米ドル	- 67,181	09.11.2021	- 990.78
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
米ドル	15,601,735	ユーロ	- 13,192,930	09.11.2021	300,139.17
Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland					
米ドル	1,614,711	カナダ・ドル	- 2,020,000	09.11.2021	20,336.84
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
日本円	525,849,200	米ドル	- 4,791,698	09.11.2021	- 77,457.26
Citibank N.A.- London - United Kingdom					
日本円	533,232,400	米ドル	- 4,853,051	09.12.2021	- 71,185.82
UBS AG London Branch - London - United Kingdom					
先物為替契約に係る未実現純利益					127,764.11

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

	2021年 9 月30日現在	
	（米ドル）	（千円）
資産		
投資証券 - 時価	424,299,279.41	48,230,099
銀行預金およびブローカー預金	2,855,313.00	324,563
未収収益	642,334.90	73,014
先物為替契約に係る未実現純利益	127,764.11	14,523
	427,924,691.42	48,642,200

負債		
未払費用引当金	498,863.34	56,706
	498,863.34	56,706

純資産	427,425,828.08	48,585,494
-----	----------------	------------

ファンドの推移	2021年 9 月30日現在	2021年 3 月31日現在	2020年 3 月31日現在
純資産総額（米ドル）	427,425,828.08	395,362,518.61	322,987,349.64

1口当たり純資産価格			
クラスA - 分配型（米ドル）	171.83	166.52	142.32
クラスB米ドル（acc）	315.67	305.91	260.56
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	1,330.70	1,284.89	1,086.57
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	1,322.79	1,277.39	1,080.46
クラスUA - 分配型（米ドル）	123.52	119.55	102.17
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	129.22	125.07	106.27
クラスBH円建て（acc）	11,253.00	10,931.00	9,395.00

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）	164,667.497	133,040.611	34,646.532	3,019.646
クラスB米ドル（acc）	828,097.820	819,194.754	105,383.289	96,480.223
クラスEB - 元本成長型（米ドル）	6,680.506	6,867.893	945.473	1,132.860
クラスIB - 元本成長型（米ドル）	38,205.090	40,045.194	4,559.028	6,399.132
クラスUA - 分配型（米ドル）	216,561.008	175,582.524	52,554.083	11,575.599
クラスUB - 元本成長型（米ドル）	288,853.346	258,097.873	37,392.872	6,637.399
クラスBH円建て（acc）	140,988.818	94,597.460	46,391.358	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）

2021年4月1日から
2021年9月30日までの期間
(米ドル) (千円)

期首現在純資産	395,362,518.61	44,940,857
収益		
投資証券に係る利息（純額）	1,417,738.94	161,154
配当金（純額）	132,909.10	15,108
銀行利息	52.63	6
証券貸付収益	7,065.94	803
その他の収益	76,635.23	8,711
	1,634,401.84	185,782
費用		
管理報酬	2,454,815.42	279,039
保管報酬	132,209.87	15,028
管理事務代行費用	127,106.17	14,448
印刷および公告費	4,033.38	458
利息および銀行手数料	247.47	28
監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用	66,460.76	7,555
年次税	56,598.77	6,434
	2,841,471.84	322,990
純利益（損失）	(1,207,070.00)	(137,208)
実現利益（損失）		
投資対象売却	3,348,811.95	380,659
先物為替契約	48,538.02	5,517
外国為替	(3,615.21)	(411)
	3,393,734.76	385,766
実現純利益（損失）	2,186,664.76	248,558
未実現純評価益（評価損）の変動		
投資対象	10,426,460.53	1,185,176
先物為替契約	72,073.34	8,193
	10,498,533.87	1,193,368

運用の結果による純資産の純増加（減少）	12,685,198.63	1,441,927
申込み / 買戻し		
申込み	62,711,774.42	7,128,447
買戻し	(43,333,663.58)	(4,925,738)
	19,378,110.84	2,202,710
期末現在純資産	427,425,828.08	48,585,494

注記は当財務書類の一部である。

注記（2021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。

2021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。

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、2021年9月30日現在の投資の市場価格に基づく2021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る。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。

2021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・グロース・EUR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。

保管報酬

保管受託銀行は、ルクセンブルグの通常の慣行に従い、ファンドから当該報酬および手数料を受け取る。かかる報酬および手数料は、関連するサブ・ファンドの純資産に対する割合で計算された報酬および取引ベースの手数料から構成される。

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TER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TER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TER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。

^{*} 2020年9月25日付で、スイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション（SFAMA）はアセット・マネジメント・プラットフォーム（AMP）と合併し、アセット・マネジメント・アソシエーション・スイス（AMAS）となった。

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、2021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 = 1.081100 スイス・フラン

1 米ドル = 0.932827 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、2021年1月1日から2021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	12,310,842.00	12,942,417.18
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	22,950,743.00	24,128,170.16
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	3,430,540.00	3,606,534.78
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	618,524.00	650,255.74
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	1,035,722.00	1,088,856.98
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	44,775.00	47,072.06
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	21,222,648.00	22,311,419.82
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	47,729,557.00	50,178,195.67
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	9,893,546.00	10,401,108.21

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。

2021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	9,238.55	3,695.42	5,543.13
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	21,020.20	8,408.08	12,612.12
クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD	米ドル	2,412.10	964.84	1,447.26
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	1,929.30	771.72	1,157.58
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	2,420.30	968.12	1,452.18
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	212.52	85.01	127.51
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	23,204.22	9,281.69	13,922.53
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	33,959.95	13,583.98	20,375.97
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	11,776.57	4,710.63	7,065.94

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。

2021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。

サブ・ファンド	通貨	取引費用
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	13,094.56
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	5,496.27
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	14,204.27
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	12,810.60
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	8,633.82
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	20,655.39
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	22,739.87
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	22,784.20
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	10,945.47

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。

2021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。

管理会社の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。

ブレグジット

指令2009/65/ECにおける投資家への開示に関する規則によれば、UCITS管理会社は、英国の欧州連合（EU）離脱（ブレグジット）および2020年12月31日現在の移行期間終了の結果を投資家に通知するために、数多くの措置を講じなければならない。特に、指令2009/65/ECの第72条および第78条に従い、UCITS管理会社は、目論見書の必須要素および主要投資家情報文書を最新の状態に保たなければならない。これには、管理会社が認可されており、UCITSが国境を越えて管理または販売されている加盟国に関する情報が含まれる。

さらに、UCITS管理会社は、投資ファンドの法的地位の変更が、投資家に以前伝えられたファンドの投資戦略の遵守に影響を与えるかどうかを評価しなければならない。

クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイは依然としてルクセンブルグに所在し、CSSFの認可を受けているため、ブレグジットによる全般的な影響は極めて限定的である。また、投資家に以前伝えられたファンドの投資戦略の遵守に重大な影響はない。CSインベストメント・ファンズ・12はUCITSファンドのままであり、ポートフォリオ運用の委任先も任命された保管受託銀行も変更はなかった。

過去に販売のために英国内で登録されたサブ・ファンドは、一時的許可制度（TPR）の下で、英国の金融行動監視機構（FCA）に通知された。その結果、CSインベストメント・ファンズ・12および通知されたサブ・ファンドは、最大3年間続くTPR期間中、英国で一般に販売する資格を引き続き有している。管理会社が、英国の新たに適用される各国内法の下で、TPR終了前にサブ・ファンドの登録を行わないことを決定した場合、かかるTPR登録は、FCAへの登録解除の通知なしに自動的に終了する。

投資ガイドラインが、ヨーロッパ、EUまたは欧州経済領域（EEA）という指定を用いて地理的範囲を決定した場合、地理的範囲は現状のままであるという趣旨の修正が投資ガイドラインになされた。すなわち、英国への投資は原則として引き続き許可され、投資家にとってこの点で何も変わらない。但し、一部の商品が、英国法の下で上場デリバティブ（ETD）としてではなく、EU法の下で店頭デリバティブ（OTC）として適格となる場合はある。対象となる投資は、ブレグジット後に適格な投資対象から外れる可能性があるかどうか商品/資産タイプに応じて調査され、必要に応じて、売却された。

EUおよび国内法を継続的に遵守するために必要な場合、トレードフローは新たな要件を満たすように再調整されている。例えば、あるデリバティブ・カテゴリーに対するMIFIRに基づくデリバティブ取引義務(DTO)を遵守するために、英国の多角的取引施設(MTFs)はEUに所在するMTFsに置き換えられた。

2021年1月1日から2022年6月30日までの18ヶ月間有効である英国の中央清算機関(CCPs)に関する一時的な同等性の決定が終了することを見据え、英国の中央清算機関からEUの承認または認定を受けた中央清算機関に清算業務を移行させるための準備措置が2020年10月に遡って開始された。

CSインベストメント・ファンズ・12の投資家については、ブレグジット移行期間終了後も、地理的市場および商品タイプに対するエクスポージャーならびに法域内のファンド株式/受益証券の利用可能性は変わっていない。

後発事象

当期末以降に生じた重要な事象はなかった。

[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(2021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

国内別記	
ルクセンブルグ	48.13
アイルランド	21.55
アメリカ合衆国	21.29
ドイツ	1.39
国際機関	0.97
オランダ	0.91
オーストラリア	0.78
スイス	0.57
メキシコ	0.54
カナダ	0.38
フランス	0.28
ノルウェー	0.24
イタリア	0.19
スペイン	0.14
ベルギー	0.08
ポーランド	0.06
ポルトガル	0.06
フィンランド	0.05
オーストリア	0.04
ガーナジー	0.00
合計	97.66
業種別内訳	
投資信託 / ファンド	69.34
国および中央政府	9.53
銀行・その他の金融機関	4.11
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	3.34
コンピューターハードウェア・ネットワーク	2.60
食品・清涼飲料	1.00
金融・投資・その他の多角化企業	1.00
国際機関	0.97
医薬品・化粧品・医療品	0.94
通信	0.70
小売り・百貨店	0.57
エネルギー・水道	0.53
カントン(州)・連邦国家・プロビンス(州)	0.38
電子・半導体	0.37
宿泊・仕出し・娯楽施設	0.37
建築材・建設業	0.30
公共・非営利機関	0.29
各種消費財	0.27
自動車	0.21
交通・運輸	0.17
繊維・衣服・革製品	0.15
機械工学・産業機器	0.12
バイオテクノロジー	0.09
保険会社	0.08
化学	0.07
電気機器・部品	0.06
石油	0.03
各種サービス	0.01
写真・光学	0.01
ヘルスケア・社会福祉	0.01
グラフィック出版・印刷メディア	0.00
時計・宝飾品	0.00
不動産	0.00
合計	97.66

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			
CHF ABB REG	2,054	69,117.91	0.02
USD ABBVIE	6,096	657,575.52	0.15
USD ACCENTURE A	2,139	684,308.88	0.16
CHF ADECCO REG	521	26,261.48	0.01
EUR ADIDAS REG	140	44,100.37	0.01
USD ADOBE	1,533	882,578.76	0.20
EUR AIR LIQUIDE	348	55,891.34	0.01
CHF ALCON INC	437	35,622.33	0.01
EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	307	69,323.61	0.02
USD ALPHABET A	1,813	4,847,091.76	1.11
USD AMAZON.COM	725	2,381,654.00	0.54
USD AMGEN	1,892	402,333.80	0.09
USD APPLE	18,116	2,563,414.00	0.59
EUR ASML HOLDING	313	234,301.10	0.05
EUR AXA	1,418	39,581.07	0.01
CHF BALOISE-HOLDING REG	177	27,000.82	0.01
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	4	304.88	0.00
EUR BASF REG	677	51,666.51	0.01
EUR BBVA REG	8,000	53,005.74	0.01
EUR BMW	244	23,403.19	0.01
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	7,788	460,815.96	0.11
CHF CEMBRA MONEY REG	159	10,721.28	0.00
CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	773	80,728.42	0.02
USD CISCO SYSTEMS	14,570	793,045.10	0.18
CHF CLARIANT (REG. SHARES)	826	15,606.59	0.00
USD COCA-COLA	13,498	708,240.06	0.16
EUR CRH PLC	579	27,217.06	0.01
CHF CS GROUP (REG. SHARES)	3,559	35,459.25	0.01
EUR DANONE	455	31,138.38	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES SE	480	25,292.00	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE REG	140	22,796.55	0.01
EUR ENEL	5,996	46,218.23	0.01
EUR ESSILORLUXOTTICA	209	40,087.50	0.01
CHF FLUGHAFEN ZUERICH	11	1,969.28	0.00
CHF GEBERIT	37	27,328.75	0.01
CHF GIVAUDAN REG	19	86,809.23	0.02
USD HOME DEPOT	3,785	1,242,464.10	0.28
EUR IBERDROLA	5,266	52,998.71	0.01
CHF IDORSIA LTD	258	6,245.14	0.00
EUR INDITEX	805	29,686.62	0.01
EUR ING GROUP	2,877	41,905.48	0.01
USD INTEL	14,348	764,461.44	0.17
EUR INTESA SANPAOLO	12,193	34,670.60	0.01
USD JOHNSON & JOHNSON	9,021	1,456,891.50	0.33
USD JP MORGAN CHASE	10,508	1,720,054.52	0.39
CHF JULIUS BAER GRUPPE	27	1,803.81	0.00
EUR KERING	55	39,265.23	0.01
EUR KON DSM	127	25,426.49	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	811	27,008.28	0.01
CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	6	2,054.40	0.00
CHF LAFARGEHOLOCM REG	1,117	54,052.22	0.01
CHF LANDIS+GYR GROUP AG	167	10,813.15	0.00
USD LINDE PLC	1,808	530,431.04	0.12
CHF LINDT & SPRUENGLI	2	22,340.69	0.01
CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	418	37,308.82	0.01
CHF LONZA REG	93	69,947.37	0.02
EUR L'OREAL	185	76,510.69	0.02
USD MASTERCARD	2,904	1,009,662.72	0.23
USD MCDONALD'S	2,545	613,624.95	0.14
USD MERCK & CO	8,725	655,334.75	0.15
USD MICROSOFT	20,269	5,714,236.48	1.30
EUR MUEENCHENER RUECKVER REG RESTRICTED	105	28,828.30	0.01
EUR NESTE OYJ	400	22,701.51	0.01
CHF NESTLE REG	4,567	551,764.51	0.13
USD NIKE B	4,266	619,551.18	0.14
CHF NOVARTIS REG	3,605	296,916.91	0.07
USD NVIDIA	8,188	1,696,226.08	0.39
EUR ORANGE	1,471	15,943.43	0.00
CHF PARTNERS GROUP	48	75,460.93	0.02
USD PAYPAL HOLDINGS	5,117	1,331,494.57	0.30
USD PEPSICO	4,709	708,280.69	0.16
USD PROCTER & GAMBLE	8,519	1,190,956.20	0.27
EUR PROSUS NV	359	28,704.19	0.01
CHF ROCHE HOLDING CERT	1,136	416,427.86	0.10
EUR ROYAL PHILIPS	674	29,948.61	0.01
CHF S&P 500 (PUT) -2600- 19/03/21	6	310.03	0.00
CHF S&P 500 (PUT) -3200- 19/03/21	28	7,369.00	0.00
USD SALESFORCE.COM	2,230	604,820.60	0.14
EUR SAP SE	769	104,167.26	0.02
CHF SCHINDLER HOLDING	2	517.57	0.00
CHF SCHINDLER HOLDING PART	5	1,346.44	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	407	67,876.57	0.02
CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES	8	11,491.95	0.00
CHF SFS GROUP (REG. SHARES)	21	2,863.55	0.00
CHF SGS REG	19	55,523.69	0.01

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	SIEMENS REG	633	104,114.69	0.02
CHF	SIKA LTD	210	66,816.24	0.02
CHF	SOFTWAREONE HOLDING AG	721	15,883.49	0.00
CHF	SONOVA HOLDING REG	76	28,939.12	0.01
CHF	STADLER RAIL AG	147	6,142.68	0.00
CHF	STRAUMANN HOLDING (REG. SHARES)	1	1,804.73	0.00
CHF	SWISS LIFE REG	93	47,206.50	0.01
CHF	SWISS PRIME SITE	139	13,619.46	0.00

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 (%)
CHF SWISS REINSURANCE	551	47,336.90	0.01	証券取引所に上場されていない証券			
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	48	27,652.71	0.01				
CHF TEMENOS GROUP	8	1,090.02	0.00	債券			
USD TESLA MOTORS	1,159	898,781.32	0.21	CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	1,074,000	898,210.51	0.21
USD TEXAS INSTRUMENTS	3,149	605,269.29	0.14	債券合計		898,210.51	0.21
EUR TOTAL	1,821	87,235.37	0.02	証券取引所に上場されていない証券合計			
CHF UBS GROUP	4,245	68,260.24	0.02			898,210.51	0.21
USD UNION PACIFIC	2,333	457,291.33	0.10	投資信託			
USD VERIZON COMMUNICATIONS	14,388	777,095.88	0.18	投資信託受益証券（オープン・エンド型）			
CHF VIFOR PHARMA AG	151	19,667.63	0.00	USD CREDIT SUISSE (LUX)	18,400	14,261,104.00	3.26
USD VISA A	5,638	1,255,864.50	0.29	COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD			
USD WALT DISNEY	6,015	1,017,557.55	0.23	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN	370	997,362.84	0.23
EUR WOLTERS KLUWER	201	21,333.46	0.00	DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR			
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	262	107,740.44	0.02	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY	22,008	5,445,567.64	1.24
株式合計		43,347,405.09	9.90	GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR			
債券				USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH	6,416	8,925,669.86	2.04
USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023	3,500,000	3,608,990.00	0.82	YIELD BOND FUND -MB- USD			
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	4,000,000	4,380,160.00	1.00	USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY	2,035	5,718,989.47	1.31
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	1,000,000	1,117,620.00	0.26	FUND EB USD			
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	130,000	160,028.74	0.04	USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY	2,298	5,374,148.76	1.23
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	2,000,000	2,228,100.00	0.51	FUND B USD			
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN	900,000	940,320.00	0.21	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO	16,160	2,813,227.81	0.64
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	170,000	221,460.05	0.05	CORPORATE BOND FUND -EB- EUR			
EUR BELGIUM OLO S 81 0.8%/17-220627	100,000	123,855.83	0.03	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI	399,357	66,141,506.34	15.10
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	100,000	118,452.80	0.03	USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B			
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A	100,000	126,909.66	0.03	USD CAP			
1.4/300728				USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI	25,660	4,208,240.00	0.96
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-150229	250,000	303,981.00	0.07	WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF			
EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05%/17-010827	150,000	191,904.74	0.04	B USD CAP			
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	2,500,000	2,369,275.00	0.54	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	178	176,575.12	0.04
CHF CSG GUERNSEY VII LTD S B CV 3%/21-121121	1,000	1,151.82	0.00	SICAV - CSIF			
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	1,000,000	1,027,510.00	0.23	(LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	1,000,000	1,015,520.00	0.23	MARKETS LOCAL -QBX USD- USD			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	1,000,000	1,078,430.00	0.25	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	8,728	9,242,690.16	2.11
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	250,000	288,001.97	0.07	SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT			
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	150,000	183,162.20	0.04	EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD			
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	250,000	308,773.25	0.07	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	18,887	24,695,056.43	5.64
EUR FRANCE OAT 0%/16-250522	200,000	232,823.78	0.05	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING			
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	150,000	210,549.34	0.05	MARKETS ESG BLUE -QBX- USD			
EUR GERMANY 1%/14-150824	100,000	121,646.87	0.03	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	10,150	14,710,883.23	3.36
EUR GERMANY 1.5%/13-150523	100,000	120,083.45	0.03	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG			
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	3,000,000	3,399,300.00	0.78	BLUE -QBX EUR ACC- EUR			
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	150,000	175,998.15	0.04	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	7,250	9,264,014.97	2.12
EUR ITALY BTP 1.5%/15-010625	150,000	184,008.81	0.04	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG			
EUR ITALY BTP 1.65%/15-010332	150,000	186,545.17	0.04	BLUE -QBX- JPY			
USD JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN	2,000,000	2,004,540.00	0.46	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	3,930	6,036,513.10	1.38
FRN/20-16.09.2024				SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG			
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	3,000,000	3,074,070.00	0.70	BLUE -QBX GBP ACC- GBP			
USD KFW 2%/17-29.09.2022	2,000,000	2,036,700.00	0.47	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	3,346	4,308,276.14	0.98
AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023	19,000	14,627.56	0.00	SICAV - CSIF (LUX)EQUITY PACIFIC EX			
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901-	1,000,000	1,047,390.00	0.24	JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD			
2.125%/15-11.02.2025				CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	4,318	4,177,542.57	0.95
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	2,000,000	2,112,420.00	0.48	SICAV - CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG			
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	150,000	182,572.87	0.04	BLUE -QBX CAD ACC- CAD			
EUR OBRIGACOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	100,000	133,312.86	0.03	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS	2,560	4,513,174.95	1.03
EUR OBRIGACOES DO TESOURO 2.125%/18-171028	100,000	134,069.65	0.03	(LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE			
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	200,000	238,145.68	0.05	BOND FUND EB USD			
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	932,000	777,893.08	0.18	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT	41,777	50,526,297.33	11.54
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	200,000	247,199.40	0.06	SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND			
EUR SPAIN 1.6%/14-300425	100,000	124,386.63	0.03	FUND -EB- USD			
EUR SPAIN 2.75%/14-311024	100,000	127,516.95	0.03	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	1,493	4,753,682.14	1.09
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	1,500,000	1,522,305.00	0.35	SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY			
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	1,063,000	942,403.01	0.22	FUND -EB- USD			
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	448,000	346,242.21	0.08	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	1,695	2,090,290.95	0.48
USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023	3,500,000	3,588,183.59	0.82	SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY			
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	3,500,000	3,661,328.13	0.84	FUND -EBP USD- USD			
USD US 4.5%/06-15.02.2036	2,500,000	3,414,843.75	0.78	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	2,524	3,653,338.56	0.83
USD US 4.625%/10-15.02.2040	2,000,000	2,871,250.00	0.66	SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT			
USD US S. C-2022 1.75%/12-15.05.2022	4,500,000	4,547,109.38	1.04	EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD			
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	3,500,000	3,684,570.33	0.84	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	228	350,801.34	0.08
USD US S. F-2022 1.625%/12-15.11.2022	4,500,000	4,575,761.73	1.04	SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND			
USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021	2,500,000	2,503,710.95	0.57	EQUITY FUND -EB- CHF			
USD US TREASURY 1.625%/16-150526	2,000,000	2,063,281.26	0.47	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	5,333	8,317,026.82	1.90
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	3,500,000	3,867,500.00	0.88	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET			
投資信託受益証券（オープン・エンド型）				CORPORATE BOND FUND -EB- USD			
合計				USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	5,263	7,558,141.67	1.73
				SUISSE (LUX) EMERGING MARKET			
投資信託合計				CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND			
				FUND -EB- USD			
ポートフォリオ合計				USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT	10,812	10,990,506.12	2.51
				SUISSE (LUX) ALTERNATIVE			
銀行預金およびブローカー預金				OPPORTUNITIES FUND -EA- USD			
				USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA	10,194	1,647,044.58	0.38
				RMB EQUITY FUND EB USD CAP			
				USD CSIF 1E FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B	80,147	10,864,727.32	2.48
				USD- EUR			
				USD CSIF 1E MSCI USA SMALL CAP ESG -B	72,048	11,900,888.64	2.72
				USD- EUR			
その他の純負債				投資信託受益証券（オープン・エンド型）			
				合計	303,663,288.86	69.34	
				投資信託合計	303,663,288.86	69.34	
				ポートフォリオ合計	427,642,262.36	97.66	
				銀行預金およびブローカー預金	10,644,888.47	2.43	
				その他の純負債	-379,793.07	-0.09	

USD	US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	3,000,000	3,220,781.25	0.74	<u>純資産総額</u>	<u>437,907,357.76</u>	<u>100.00</u>
USD	VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	2,000,000	2,244,680.00	0.51			
<u>債券合計</u>			<u>79,733,357.90</u>	<u>18.21</u>			
<u>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合計</u>			<u>123,080,762.99</u>	<u>28.11</u>			

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（2021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		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					
ルクセンブルグ	44.38	CHF ABB REG	1,015	34,155.15	0.02
アイルランド	26.63	USD ABBVIE	4,470	482,178.90	0.28
アメリカ合衆国	21.69	USD ACCENTURE A	1,216	389,022.72	0.23
ドイツ	0.97	CHF ADECCO REG	258	13,004.72	0.01
国際機関	0.93	EUR ADIDAS REG	125	39,375.33	0.02
スイス	0.80	USD ADOBE	1,180	679,349.60	0.39
オランダ	0.70	EUR AIR LIQUIDE	311	49,948.87	0.03
オーストラリア	0.66	CHF ALCON INC	215	17,525.86	0.01
ノルウェー	0.46	EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	274	61,871.89	0.04
フランス	0.27	USD ALPHABET A	1,390	3,716,192.80	2.16
カナダ	0.18	USD AMAZON.COM	550	1,806,772.00	1.05
メキシコ	0.14	USD AMGEN	1,410	299,836.50	0.17
イタリア	0.11	USD APPLE	13,800	1,952,700.00	1.13
スペイン	0.07	EUR ASML HOLDING	280	209,598.43	0.12
ベルギー	0.05	EUR AXA	1,267	35,366.17	0.02
ポーランド	0.03	CHF BALOISE-HOLDING REG	87	13,271.59	0.01
フィンランド	0.01	CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	4	304.88	0.00
合計	98.08	EUR BASF REG	605	46,171.70	0.03
業種別内訳					
投資信託 / ファンド	70.60	EUR BBVA REG	8,000	53,005.74	0.03
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	6.40	EUR BMW	218	20,909.41	0.01
銀行・その他の金融機関	3.92	USD BRISTOL MYERS SQUIBB	5,980	353,836.60	0.21
コンピュータハードウェア・ネットワーク	2.58	CHF CEMBRA MONEY REG	80	5,394.35	0.00
国および中央政府	2.16	CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	383	39,998.69	0.02
医薬品・化粧品・医療品	1.73	USD CISCO SYSTEMS	11,200	609,616.00	0.35
金融・投資・その他の多角化企業	1.42	CHF CLARIANT (REG. SHARES)	410	7,746.61	0.00
小売り・百貨店	1.10	USD COCA-COLA	10,440	547,786.80	0.32
食品・清涼飲料	0.98	EUR CRH PLC	518	24,349.63	0.01
国際機関	0.93	CHF CS GROUP (REG. SHARES)	1,758	17,515.41	0.01
電子・半導体	0.75	EUR DANONE	406	27,785.02	0.02
宿泊・仕出し・娯楽施設	0.72	EUR DASSAULT SYSTEMES SE	430	22,657.41	0.01
エネルギー・水道	0.70	EUR DEUTSCHE BOERSE REG	125	20,354.06	0.01
通信	0.69	EUR ENEL	5,359	41,308.12	0.02
建築材・建設業	0.59	EUR ESSLORLUXOTTICA	187	35,867.76	0.02
各種消費財	0.53	CHF FLUGHAFEN ZUERICH	5	895.13	0.00
自動車	0.40	CHF GEBERIT	20	14,772.30	0.01
公共・非営利機関	0.35	CHF GIVAUDAN REG	10	45,689.07	0.03
繊維・衣服・革製品	0.30	USD HOME DEPOT	2,950	968,367.00	0.56
交通・運輸	0.21	EUR IBERDROLA	4,705	47,352.63	0.03
カントン（州）・連邦国家・プロビンス（州）	0.18	CHF IDORSIA LTD	128	3,098.37	0.00
機械工学・産業機器	0.18	EUR INDITEX	719	26,515.13	0.02
バイオテクノロジー	0.17	EUR ING GROUP	2,571	37,448.37	0.02
保険会社	0.15	USD INTEL	11,020	587,145.60	0.34
電気機器・部品	0.12	EUR INTESA SANPAOLO	10,896	30,982.60	0.02
化学	0.11	USD JOHNSON & JOHNSON	6,880	1,111,120.00	0.64
石油	0.05	USD JP MORGAN CHASE	7,960	1,302,972.40	0.76
写真・光学	0.02	CHF JULIUS BAER GRUPPE	13	868.50	0.00
グラフィック出版・印刷メディア	0.01	EUR KERING	49	34,981.75	0.02
各種サービス	0.01	EUR KON DSM	113	22,623.57	0.01
ヘルスケア・社会福祉	0.01	EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	725	24,144.27	0.01
時計・宝飾品	0.00	CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	3	1,027.20	0.00
不動産	0.00	CHF LAFARGEHOLCIM REG	552	26,711.57	0.02
合計	98.08	CHF LANDIS+GYR GROUP AG	83	5,374.20	0.00
		USD LINDE PLC	1,028	301,594.64	0.17
		CHF LINDT & SPRUENGLI	2	22,340.69	0.01
		CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	207	18,475.90	0.01
		CHF LONZA REG	47	35,349.74	0.02
		EUR L'OREAL	165	68,239.27	0.04
		USD MASTERCARD	2,210	768,372.80	0.45
		USD MCDONALD'S	1,910	460,520.10	0.27
		USD MERCK & CO	6,690	502,485.90	0.29
		USD MICROSOFT	15,450	4,355,664.00	2.53
		EUR MUENCHENER RUECKVER REG RESTRICTED	94	25,808.19	0.01
		EUR NESTE OYJ	280	15,891.06	0.01
		CHF NESTLE REG	2,643	319,315.44	0.19
		USD NIKE B	3,250	471,997.50	0.27
		CHF NOVARTIS REG	2,106	173,455.48	0.10
		USD NVIDIA	6,230	1,290,606.80	0.75
		EUR ORANGE	1,314	14,241.79	0.01
		CHF PARTNERS GROUP	25	39,302.57	0.02
		USD PAYPAL HOLDINGS	3,900	1,014,819.00	0.59
		USD PEPSICO	3,560	535,459.60	0.31
		USD PROCTER & GAMBLE	6,540	914,292.00	0.53
		EUR PROSUS NV	321	25,665.86	0.01
		CHF ROCHE HOLDING CERT	659	241,572.15	0.14
		EUR ROYAL PHILIPS	602	26,749.35	0.02
		CHF S&P 500 (PUT) -2600- 19/03/21	2	103.34	0.00
		CHF S&P 500 (PUT) -3200- 19/03/21	14	3,684.50	0.00
		USD SALESFORCE.COM	1,710	463,786.20	0.27
		EUR SAP SE	687	93,059.70	0.05
		CHF SCHINDLER HOLDING	1	258.78	0.00
		CHF SCHINDLER HOLDING PART	2	538.58	0.00
		EUR SCHNEIDER ELECTRIC	364	60,705.34	0.04
		CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES	3	4,309.48	0.00
		CHF SFS GROUP (REG. SHARES)	10	1,363.60	0.00
		CHF SGS REG	10	29,222.99	0.02

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	SIEMENS REG	568	93,423.61	0.05
CHF	SIKA LTD	103	32,771.77	0.02
CHF	SOFTWAREONE HOLDING AG	357	7,864.64	0.00
CHF	SONOVA HOLDING REG	38	14,469.56	0.01
CHF	STADLER RAIL AG	74	3,092.23	0.00
CHF	SWISS LIFE REG	65	32,993.79	0.02
CHF	SWISS PRIME SITE	70	6,858.72	0.00
CHF	SWISS REINSURANCE	272	23,367.76	0.01

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）

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 (%)
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	25	14,402.45	0.01	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	48	47,870.46	0.03
CHF TEMENOS GROUP	5	681.26	0.00	SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT			
USD TESLA MOTORS	860	666,912.80	0.39	EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD			
USD TEXAS INSTRUMENTS	2,470	474,758.70	0.28	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	1,620	1,715,531.40	0.99
EUR TOTAL	1,627	77,941.76	0.05	SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT			
CHF UBS GROUP	2,097	33,720.07	0.02	EMERGING MARKETS USD -QBX USD- USD			
USD UNION PACIFIC	1,800	352,818.00	0.20	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	11,241	14,697,719.91	8.52
USD VERIZON COMMUNICATIONS	11,030	595,730.30	0.35	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING			
CHF VIFOR PHARMA AG	76	9,898.94	0.01	MARKETS ESG BLUE -QBX- USD			
USD VISA A	4,370	973,417.50	0.56	EUR CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	5,922	8,583,039.46	4.98
USD WALT DISNEY	4,600	778,182.00	0.45	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG			
EUR WOLTERS KLUWER	180	19,104.60	0.01	BLUE -QBX EUR ACC- EUR			
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	156	64,150.79	0.04	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	3,852	4,922,066.99	2.85
株式合計		32,542,681.97	18.87	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG			
債券				BLUE -QBX- JPY			
USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023	750,000	773,355.00	0.45	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	2,390	3,671,060.13	2.13
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	1,000,000	1,095,040.00	0.64	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	500,000	558,810.00	0.32	BLUE -QBX GBP ACC- GBP			
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	1,000,000	1,114,050.00	0.65	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	1,983	2,553,290.97	1.48
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	60,000	78,162.37	0.05	SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX			
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	250,000	236,927.50	0.14	JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD			
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	500,000	513,755.00	0.30	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	2,565	2,481,564.78	1.44
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	500,000	539,215.00	0.31	SICAV -CSIF(LUX) EQUITY CANADA ESG			
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	30,000	42,109.87	0.02	BLUE -QBX CAD ACC- CAD			
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	750,000	849,825.00	0.49	USD CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS	856	1,510,181.04	0.88
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	100,000	117,332.10	0.07	(LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE			
USD JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/20-16.09.2024	750,000	751,702.50	0.44	BOND FUND EB USD			
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	750,000	768,517.50	0.45	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT	5,620	6,796,940.40	3.94
USD KFW 2%/17-29.09.2022	500,000	509,175.00	0.30	SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND			
AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023	2,000	1,539.74	0.00	FUND -EB- USD			
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	750,000	785,542.50	0.46	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	682	2,171,474.36	1.26
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	500,000	528,105.00	0.31	SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY			
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	340,000	283,780.74	0.16	FUND -EB- USD			
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	35,000	43,259.89	0.03	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	1,067	1,315,835.07	0.76
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	500,000	507,435.00	0.29	SUISSE (LUX) EDUTAINMENT EQUITY			
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	470,000	416,678.66	0.24	FUND -EBP USD- USD			
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	244,000	188,578.35	0.11	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	1,112	1,609,553.28	0.93
USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023	500,000	512,597.66	0.30	SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT			
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	600,000	627,656.25	0.36	EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD			
USD US 4.5%/06-15.02.2036	200,000	273,187.50	0.16	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT	113	173,862.07	0.10
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	500,000	526,367.19	0.31	SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND			
USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021	300,000	300,445.31	0.17	EQUITY FUND -EB- CHF			
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	250,000	251,679.69	0.15	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	2,030	3,165,866.20	1.84
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	500,000	531,718.75	0.31	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET			
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	250,000	276,250.00	0.16	CORPORATE BOND FUND -EB- USD			
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	250,000	268,398.44	0.16	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT	692	993,774.28	0.58
USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	500,000	561,170.00	0.33	SUISSE (LUX) EMERGING MARKET			
債券合計		14,832,367.51	8.60	CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND			
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合計		47,375,049.48	27.47	FUND -EB- USD			
証券取引所に上場されていない証券				USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT	4,180	4,249,011.80	2.46
債券				SUISSE (LUX) ALTERNATIVE			
CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	32,000	26,762.32	0.02	OPPORTUNITIES FUND -EA- USD			
債券合計		26,762.32	0.02	USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA	3,006	485,679.42	0.28
証券取引所に上場されていない証券合計		26,762.32	0.02	RMB EQUITY FUND EB USD CAP			
投資信託				USD CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B	30,808	4,176,332.48	2.42
投資信託受益証券（オープン・エンド型）				USD- EUR			
USD CREDIT SUISSE (LUX)	6,804	5,273,508.24	3.06	USD CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B	28,633	4,729,598.94	2.74
COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD				USD- EUR			
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN	146	395,542.87	0.23	投資信託受益証券（オープン・エンド型）			
DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR				合計	121,733,118.56	70.60	
EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROZONE QUALITY	7,939	1,964,393.01	1.14	投資信託合計	121,733,118.56	70.60	
GROWTH EQUITY FUND -EB- EUR				ポートフォリオ合計	169,134,930.36	98.08	
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH	1,255	1,746,453.32	1.01	銀行預金およびブローカー預金	3,634,292.04	2.11	
YIELD BOND FUND -MB- USD				その他の純負債	-330,563.22	-0.19	
USD CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY	1,050	2,950,395.00	1.71	純資産総額	172,438,659.18	100.00	
FUND EB USD							
USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY	1,230	2,876,502.60	1.67				
FUND B USD							
EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO	1,000	174,085.88	0.10				
CORPORATE BOND FUND -EB- EUR							

USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI	193,010	31,966,316.20	18.54
USA ESG			
LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			
USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI	26,437	4,335,668.00	2.51
WORLD			
ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP			

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（2021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		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					
ルクセンブルグ	48.78	CHF ABB REG	1,453	48,894.02	0.01
アメリカ合衆国	24.81	USD ABBVIE	3,827	412,818.49	0.10
アイルランド	15.07	USD ACCENTURE A	1,342	429,332.64	0.10
国際機関	3.08	CHF ADECCO REG	369	18,599.78	0.00
ドイツ	2.01	EUR ADIDAS REG	56	17,640.15	0.00
オランダ	1.17	USD ADOBE	962	553,842.64	0.13
オーストラリア	1.03	EUR AIR LIQUIDE	139	22,324.41	0.01
メキシコ	0.67	CHF ALCON INC	309	25,188.33	0.01
ノルウェー	0.61	EUR ALLIANZ SE REG RESTRICTED	122	27,548.80	0.01
カナダ	0.46	USD ALPHABET A	1,140	3,047,812.80	0.71
スイス	0.41	USD AMAZON.COM	456	1,497,978.24	0.35
フランス	0.33	USD AMGEN	1,187	252,415.55	0.06
スペイン	0.28	USD APPLE	11,372	1,609,138.00	0.38
イタリア	0.25	EUR ASML HOLDING	125	93,570.73	0.02
ベルギー	0.09	EUR AXA	566	15,798.93	0.00
フィンランド	0.08	CHF BALOISE-HOLDING REG	125	19,068.38	0.00
オーストリア	0.07	CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE	3	228.66	0.00
ポーランド	0.06	EUR BASF REG	270	20,605.55	0.00
ポルトガル	0.03	EUR BBVA REG	3,000	19,877.15	0.00
合計	99.27	EUR BMW	97	9,303.73	0.00
業種別内訳		USD BRISTOL MYERS SQUIBB	4,888	289,222.96	0.07
投資信託／ファンド	63.54	CHF CEMBRA MONEY REG	113	7,619.53	0.00
国および中央政府	14.32	CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (REG. SHARES)	547	57,126.06	0.01
銀行・その他の金融機関	6.42	USD CISCO SYSTEMS	9,143	497,653.49	0.12
国際機関	3.08	CHF CLARIANT (REG. SHARES)	585	11,053.10	0.00
コンピューターハードウェア・ネットワーク	2.48	USD COCA-COLA	8,470	444,420.90	0.10
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	2.14	EUR CRH PLC	231	10,858.62	0.00
金融・投資・その他の多角化企業	1.08	CHF CS GROUP (REG. SHARES)	2,519	25,097.46	0.01
食品・清涼飲料	0.97	EUR DANONE	181	12,386.92	0.00
エネルギー・水道	0.92	EUR DASSAULT SYSTEMES SE	190	10,011.42	0.00
通信	0.91	EUR DEUTSCHE BOERSE REG	56	9,118.62	0.00
医薬品・化粧品・医療品	0.62	EUR ENEL	2,395	18,461.09	0.00
カントン（州）・連邦国家・プロビンス（州）	0.46	EUR ESSILORLUXOTTICA	83	15,919.92	0.00
小売り・百貨店	0.36	CHF FLUGHAFEN ZUERICH	8	1,432.21	0.00
交通・運輸	0.34	CHF GEBERIT	26	19,203.99	0.00
公共・非営利機関	0.29	CHF GIVAUDAN REG	14	63,964.69	0.01
宿泊・仕出し・娯楽施設	0.24	USD HOME DEPOT	2,376	779,945.76	0.18
電子・半導体	0.23	EUR IBERDROLA	2,103	21,165.27	0.00
建築材・建設業	0.19	CHF IDORSIA LTD	183	4,429.70	0.00
各種消費財	0.17	EUR INDITEX	321	11,837.77	0.00
自動車	0.13	EUR ING GROUP	1,149	16,735.97	0.00
繊維・衣服・革製品	0.10	USD INTEL	9,003	479,679.84	0.11
機械工学・産業機器	0.08	EUR INTESA SANPAOLO	4,870	13,847.77	0.00
バイオテクノロジー	0.06	USD JOHNSON & JOHNSON	5,661	914,251.50	0.21
保険会社	0.05	USD JP MORGAN CHASE	6,596	1,079,699.24	0.25
化学	0.04	CHF JULIUS BAER GRUPPE	19	1,269.35	0.00
電気機器・部品	0.03	EUR KERING	22	15,706.09	0.00
石油	0.01	EUR KON DSM	50	10,010.43	0.00
各種サービス	0.01	EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	324	10,789.99	0.00
ヘルスケア・社会福祉	0.01	CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL	5	1,712.00	0.00
グラフィック出版・印刷メディア	0.00	CHF LAFARGEHOLCIM REG	790	38,228.52	0.01
時計・宝飾品	0.00	CHF LANDIS+GYR GROUP AG	118	7,640.43	0.00
不動産	0.00	USD LINDE PLC	1,135	332,986.30	0.08
写真・光学	0.00	CHF LINDT & SPRUENGLI	1	11,170.34	0.00
合計	99.27	CHF LOGITECH INTERNATIONAL REG	296	26,419.64	0.01
		CHF LONZA REG	66	49,640.07	0.01
		EUR L'OREAL	73	30,190.71	0.01
		USD MASTERCARD	1,823	633,820.64	0.15
		USD MCDONALD'S	1,596	384,811.56	0.09
		USD MERCK & CO	5,477	411,377.47	0.10
		USD MICROSOFT	12,723	3,586,868.16	0.84
		EUR MUENCHENER RUECKVER REG RESTRICTED	42	11,531.32	0.00
		EUR NESTE OYJ	150	8,513.07	0.00
		CHF NESTLE REG	3,214	388,301.10	0.09
		USD NIKE B	2,676	388,635.48	0.09
		CHF NOVARTIS REG	2,551	210,106.81	0.05
		USD NVIDIA	5,144	1,065,631.04	0.25
		EUR ORANGE	587	6,362.20	0.00
		CHF PARTNERS GROUP	34	53,451.49	0.01
		USD PAYPAL HOLDINGS	3,209	835,013.89	0.20
		USD PEPSICO	2,956	444,611.96	0.10
		USD PROCTER & GAMBLE	5,347	747,510.60	0.17
		EUR PROSUS NV	143	11,433.70	0.00
		CHF ROCHE HOLDING CERT	804	294,725.35	0.07
		EUR ROYAL PHILIPS	269	11,952.78	0.00
		CHF S&P 500 (PUT) -2600- 19/03/21	4	206.68	0.00
		CHF S&P 500 (PUT) -3200- 19/03/21	20	5,263.57	0.00
		USD SALESFORCE.COM	1,400	379,708.00	0.09
		EUR SAP SE	307	41,585.63	0.01
		CHF SCHINDLER HOLDING	2	517.57	0.00
		CHF SCHINDLER HOLDING PART	3	807.87	0.00
		EUR SCHNEIDER ELECTRIC	162	27,017.21	0.01
		CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES	6	8,618.96	0.00
		CHF SFS GROUP (REG. SHARES)	15	2,045.40	0.00
		CHF SGS REG	14	40,912.19	0.01

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	SIEMENS REG	255	41,941.94	0.01
CHF	SIKA LTD	148	47,089.54	0.01
CHF	SOFTWAREONE HOLDING AG	510	11,235.20	0.00
CHF	SONOVA HOLDING REG	54	20,562.01	0.00
CHF	STADLER RAIL AG	104	4,345.84	0.00
CHF	STRAUMANN HOLDING (REG. SHARES)	1	1,804.73	0.00
CHF	SWISS LIFE REG	63	31,978.59	0.01
CHF	SWISS PRIME SITE	98	9,602.21	0.00

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 (%)
CHF SWISS REINSURANCE	390	33,505.24	0.01	USD US TREASURY N/B S E-30 0.625%/20-150830	1,000,000	930,625.00	0.22
CHF SWISSCOM (REG. SHARES)	34	19,587.34	0.00	USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029	3,000,000	3,367,020.00	0.79
CHF TEMENOS GROUP	6	817.51	0.00	債券合計	125,459,677.92	29.35	
USD TESLA MOTORS	728	564,549.44	0.13	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合計	152,505,550.38	35.68	
USD TEXAS INSTRUMENTS	1,976	379,806.96	0.09	証券取引所に上場されていない証券			
EUR TOTAL	727	34,827.08	0.01	債券			
CHF UBS GROUP	3,004	48,304.77	0.01	CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027	225,000	188,172.59	0.04
USD UNION PACIFIC	1,464	286,958.64	0.07	債券合計	188,172.59	0.04	
USD VERIZON COMMUNICATIONS	9,029	487,656.29	0.11	証券取引所に上場されていない証券合計	188,172.59	0.04	
CHF VIFOR PHARMA AG	107	13,936.67	0.00	投資信託			
USD VISA A	3,536	787,644.00	0.18	投資信託受益証券（オープンエンド型）			
USD WALT DISNEY	3,774	638,447.58	0.15	USD CREDIT SUISSE (LUX)	18,100	14,028,586.00	3.28
EUR WOLTERS KLUWER	80	8,490.93	0.00	EUR COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD	679	1,829,322.14	0.43
CHF ZURICH INSURANCE GROUP REG	191	78,543.60	0.02	EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN	21,433	5,303,292.04	1.24
株式合計	27,045,872.46	6.33		EUR DIVIDEND PLUS EQUITY FUND EB EUR	8,900	12,380,790.26	2.90
債券				USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH	852	2,394,664.22	0.56
USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023	4,500,000	4,640,130.00	1.09	USD YIELD BOND FUND -MB- USD	1,290	3,016,819.80	0.71
USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027	3,500,000	3,832,640.00	0.90	USD CREDIT SUISSE (LUX) SECURITY EQUITY FUND B USD	40,743	7,092,780.99	1.66
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028	2,000,000	2,235,240.00	0.52	EUR CREDIT SUISSE (LUX) SQ EURO	291,435	48,267,464.70	11.29
EUR AUSTRIA 0.75%/16-201026	250,000	307,747.58	0.07	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	10,620	1,741,680.00	0.41
USD AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029	3,500,000	3,899,175.00	0.91	USD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF B USD CAP	178	176,440.60	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025	2,500,000	2,612,000.00	0.61	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	14,676	15,541,443.72	3.64
EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-220433	280,000	364,757.72	0.09	EUR SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD	8,527	11,149,137.77	2.61
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5%/20-300430	150,000	177,679.20	0.04	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	3,760	5,449,548.86	1.27
EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 144A 1.4/300728	250,000	317,274.15	0.07	JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	4,850	6,197,306.56	1.45
EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-150229	500,000	607,961.99	0.14	GBP CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	2,680	4,116,502.57	0.96
USD COCA-COLA FEMSA SAB CV 1.85%/20-01.09.2032	3,000,000	2,843,130.00	0.67	EUR SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QBX EUR ACC- EUR	1,615	2,079,457.85	0.49
USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025	3,000,000	3,082,530.00	0.72	USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	2,270	2,196,160.64	0.51
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029	3,000,000	3,046,560.00	0.71	USD SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD	2,760	4,864,638.00	1.14
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025	2,000,000	2,156,860.00	0.50	CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX)	57,200	69,178,824.00	16.18
EUR FEDEX CORP 0.45%/21-040529	1,000,000	1,152,007.89	0.27	USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SQ US CORPORATE BOND FUND - EB- USD	627	1,996,355.46	0.47
EUR FINNISH GOVERNMENT 144A 0.5%/18-150928	270,000	329,691.95	0.08	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) DIGITAL HEALTH EQUITY FUND - EB- USD	1,029	1,268,973.09	0.30
EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-250528	300,000	370,527.90	0.09	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ENVIRONMENTAL IMPACT EQUITY FUND -EBP USD ACC- USD	1,878	2,718,292.32	0.64
EUR FRANCE OAT 1.25%/15-250536	200,000	258,682.28	0.06	CHF CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) SMALL CAP SWITZERLAND EQUITY FUND -EB- CHF	150	230,790.35	0.05
EUR FRANCE OAT 1.75%/13-250523	250,000	301,364.67	0.07	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	7,036	10,972,923.44	2.57
EUR FRANCE OAT 1.75%/17-250639	200,000	280,732.46	0.07	USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	7,970	11,445,637.30	2.68
EUR GERMANY 0.25%/17-150227	250,000	302,219.39	0.07	USD CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD	10,564	10,738,411.64	2.51
EUR GERMANY 1%/14-150824	250,000	304,117.17	0.07	USD CSIF 6 CREDIT SUISSE (LUX) CHINA	10,716	1,731,384.12	0.41
EUR GERMANY 1.5%/13-150523	250,000	300,208.61	0.07	USD RMB EQUITY FUND EB USD CAP	83,000	11,251,480.00	2.63
USD ING GROEP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026	4,000,000	4,532,400.00	1.06	USD CSIF 1E FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR	13,600	2,246,448.00	0.53
EUR INTESA SANPAOLO SPA 0.75%/21-160328	500,000	586,660.49	0.14	USD CSIF 1E MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR			
USD INTL FINANCE CORP 2.125%/16-07.04.2026	2,500,000	2,629,200.00	0.62				
EUR IRELAND 1%/16-150526	100,000	123,649.53	0.03				
EUR ITALY BTP 1.5%/15-010625	250,000	306,681.35	0.07				
EUR ITALY BTP 1.65%/15-010332	100,000	124,363.45	0.03				
USD JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/20-16.09.2024	5,000,000	5,011,350.00	1.17				
USD KFW 1.75%/19-14.09.2029	3,750,000	3,842,587.50	0.90				
USD KFW 2%/17-29.09.2022	3,000,000	3,055,050.00	0.71				
AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023	12,000	9,238.46	0.00				
USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025	2,500,000	2,618,475.00	0.61				
USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023	3,000,000	3,168,630.00	0.74				
EUR NETHERLANDS 0.5%/16-150726	250,000	304,288.12	0.07				
EUR OBRIGACOES DO TESOURO 144A 1.95%/150629	100,000	133,312.86	0.03				
EUR PROLOGIS INTL FUND II 0.875%/19-09.07.2029	350,000	416,754.94	0.10				
CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023	2,113,000	1,763,613.82	0.41				
EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026	200,000	247,199.40	0.06				
EUR SPAIN 1.6%/14-300425	250,000	310,966.57	0.07				
EUR SPAIN 2.75%/14-311024	250,000	318,792.38	0.07				
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 2.15%/20-13.02.2030	2,500,000	2,537,175.00	0.59				
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026	1,234,000	1,094,003.12	0.26				
AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029	162,000	125,203.66	0.03				
USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023	4,000,000	4,100,781.24	0.96				
USD UNITED STATES S B-2025 2%/15-150225	4,000,000	4,184,375.00	0.98				
USD US 3.5%/09-15.02.2039	3,000,000	3,755,859.39	0.88				
USD US 4.5%/06-15.02.2036	2,000,000	2,731,875.00	0.64				
USD US 4.625%/10-15.02.2040	2,000,000	2,871,250.00	0.67				
USD US S. C-2022 1.75%/12-15.05.2022	3,000,000	3,031,406.25	0.71				
USD US S. F 2024 2.25%/14-15.11.2024	4,000,000	4,210,937.52	0.99				
USD US S. F 2022 1.625%/12-15.11.2022	3,000,000	3,050,507.82	0.71				
USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021	4,750,000	4,757,050.81	1.11				
USD US TREASURY 1.625%/16-150526	3,000,000	3,094,921.89	0.72				
USD US TREASURY N/B 1.5%/20-150230	2,000,000	2,013,437.50	0.47				
USD US TREASURY N/B 1.625%/19-30.11.2026	3,000,000	3,092,343.75	0.72				

USD US TREASURY N/B 1.875%/19-31.07.2026	3,000,000	3,131,250.00	0.73
USD US TREASURY N/B 2.125%/17-290224	3,000,000	3,127,265.64	0.73
USD US TREASURY N/B 2.25%/17-151127	1,500,000	1,595,156.25	0.37
USD US TREASURY N/B 2.875%/18-150828	2,000,000	2,210,000.00	0.52
USD US TREASURY N/B S C-2029 2.375%/150529	3,000,000	3,220,781.25	0.75

投資信託受益証券（オープンエンド型）		
合計	271,605,556.44	63.54
投資信託合計	271,605,556.44	63.54
ポートフォリオ合計	424,299,279.41	99.27
銀行預金およびブローカー預金	2,855,313.00	0.67
その他の純資産	271,235.67	0.06
純資産総額	427,425,828.08	100.00

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。

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額

2021年10月末日現在、250,000スイス・フラン（約3,118万円）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、2021年10月29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＝124.73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。

2021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	9 (102のサブ・ファンドを含む)	62,859,681,019.88
ルクセンブルグ	ルクセンブルグ U C I	2 (8のサブ・ファンドを含む)	6,979,445,541.57
ルクセンブルグ	ルクセンブルグ S I F	3 (12のサブ・ファンドを含む)	5,205,446,585.07

（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。