

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年2月10日
【発行者名】	ピクテ投信投資顧問株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 萩野 琢英
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	佐藤 直紀
【電話番号】	03-3212-3411
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係る ファンドの名称】	ピクテY E Nアセット・アロケーション・ファンド(1年 決算型)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金 額】	当初申込期間：100億円を上限とします。 継続申込期間：1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、平成28年4月15日付をもって提出した有価証券届出書(平成28年5月2日付で提出の有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。)の記載事項のうち、関係情報を更新するとともに、訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するものであります。

【訂正箇所及び訂正事項】

(下線部_____は訂正箇所を示します。)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<前略>

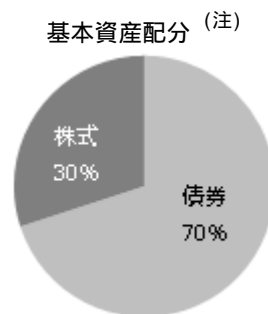
<訂正前>

ファンドの特色

<中略>

b 債券と株式にバランスよく分散投資します

<中略>



(注)平成28年4月15日現在の基本資産配分方針であり、委託会社が各資産の収益とそのリスク見通しを分析し適宜変更するため、今後変更される可能性があります。

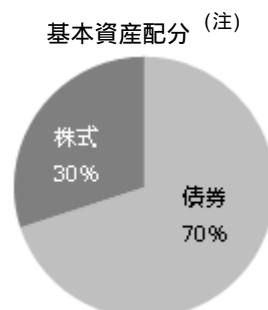
<訂正後>

ファンドの特色

<中略>

b 債券と株式にバランスよく分散投資します

<中略>



(注)平成29年2月10日現在の基本資産配分方針であり、委託会社が各資産の収益とそのリスク見通しを分析し適宜変更するため、今後変更される可能性があります。

<後略>

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成28年5月13日 信託契約締結、ファンドの設定および運用開始(予定)

<訂正後>

平成28年5月13日 信託契約締結、ファンドの設定および運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<前略>

<訂正前>

委託会社の概況(平成28年2月末日現在)

<訂正後>

委託会社の概況(平成28年12月末日現在)

<後略>

2【投資方針】**(2)【投資対象】**

<前略>

<訂正前>

指定投資信託証券の概要

指定投資信託証券は、主に公社債に投資を行う投資信託および主に株式に投資を行う投資信託(前記の各資産への投資のほか、これらに類する資産への投資、デリバティブ取引等の金融商品を利用するものおよび外貨建資産について為替ヘッジを行うものを含まず。)の受益証券または投資証券とし、平成28年4月15日現在は以下のとおりとします。

<訂正後>

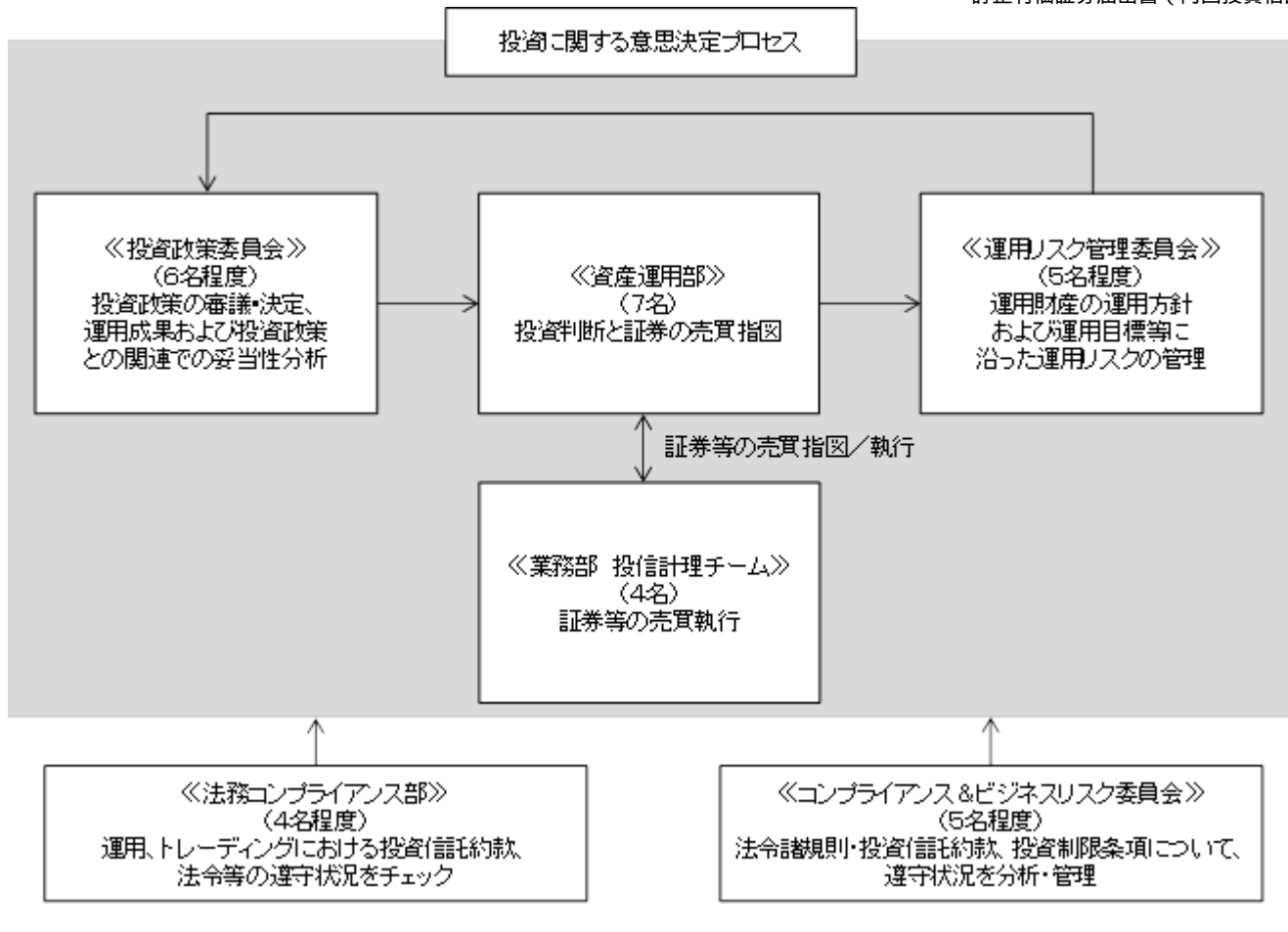
指定投資信託証券の概要

指定投資信託証券は、主に公社債に投資を行う投資信託および主に株式に投資を行う投資信託(前記の各資産への投資のほか、これらに類する資産への投資、デリバティブ取引等の金融商品を利用するものおよび外貨建資産について為替ヘッジを行うものを含まず。)の受益証券または投資証券とし、平成29年2月10日現在は以下のとおりとします。

<後略>

(3)【運用体制】

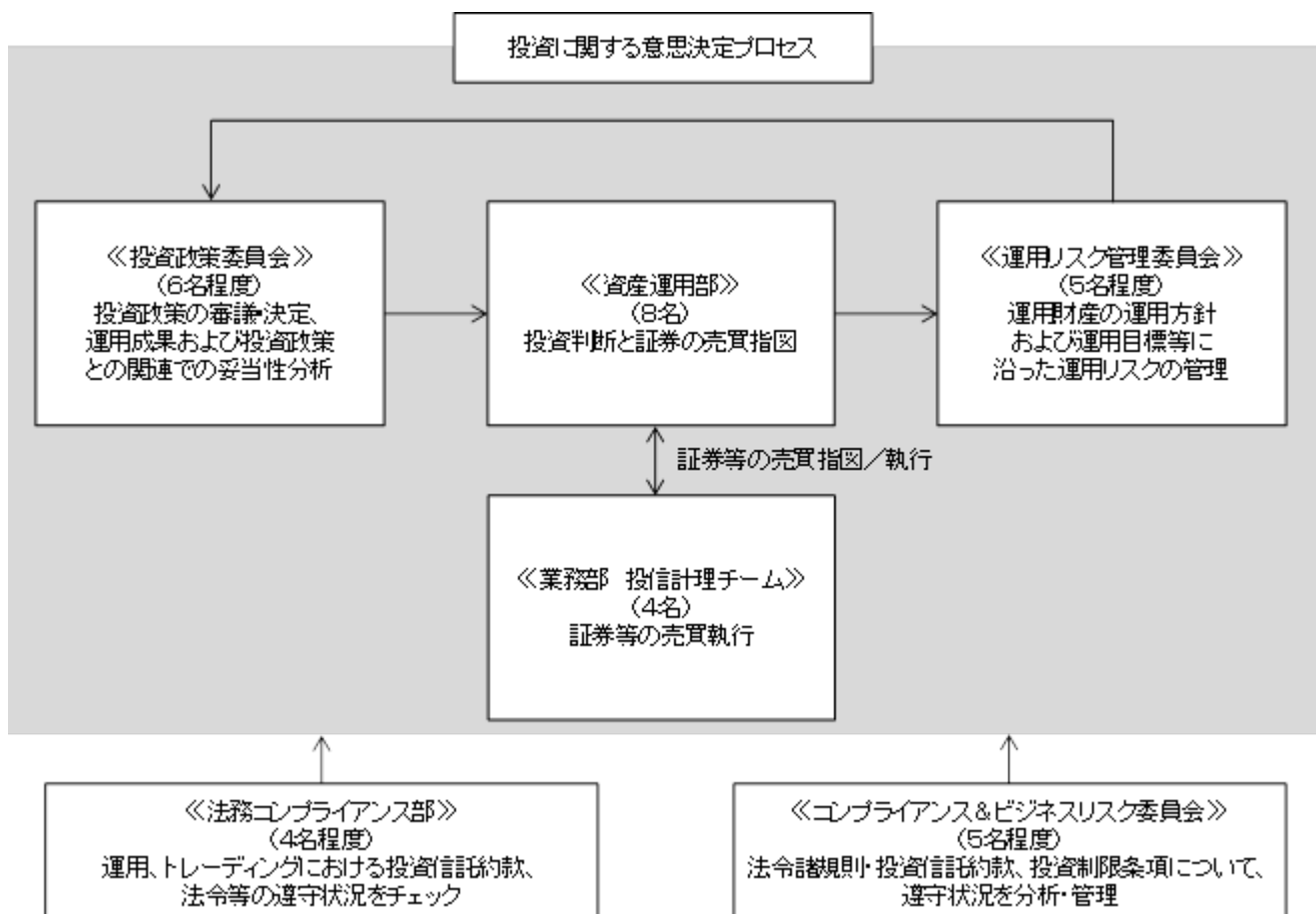
<訂正前>



< 中略 >

運用体制は、平成28年2月末日現在のものであり、今後変更される場合があります。

< 訂正後 >



< 中略 >

運用体制は、平成28年12月末日現在のものであり、今後変更される場合があります。

3【投資リスク】

< 前略 >

(2) リスクの管理体制

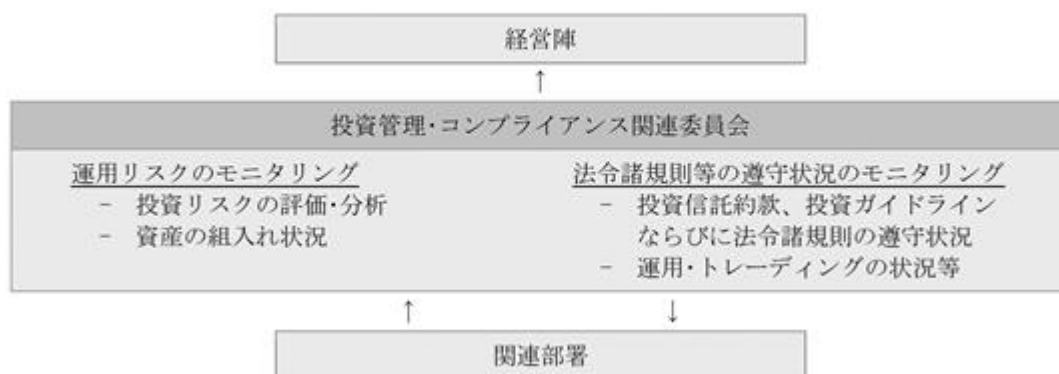
< 中略 >

< 訂正前 >

ファンドの運用におけるリスクの評価・分析および資産の組入れの状況等ならびに投資信託約款、投資ガイドライン、法令諸規則の遵守状況および運用・トレーディングの状況等のモニタリングは、運用部署から独立した部署で行っています。

モニタリングの結果は、上記部署により定期的に投資管理およびコンプライアンス関連の委員会へ報告されると共に、必要に応じて経営陣へも報告されます。また、問題点等が認識された場合は、すみやかに運用部署その他関連部署へ改善の指示または提案等を行うことにより、適切なファンドのリスク管理を行っています。

< リスクの管理体制図 >



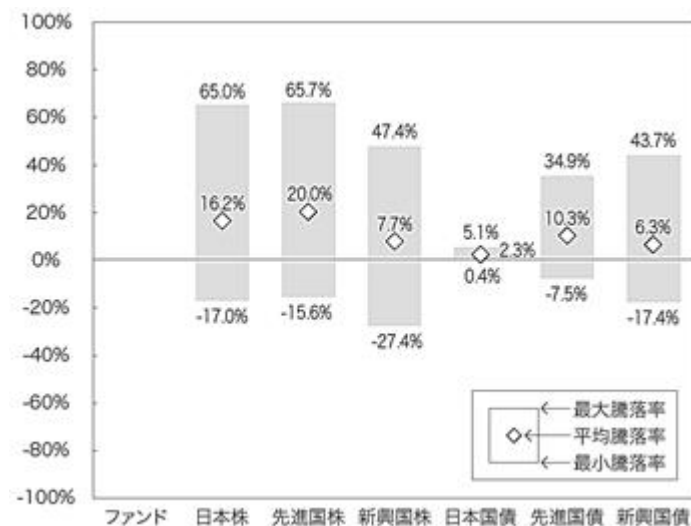
リスクの管理体制は、平成28年2月末日現在のものであり、今後変更される場合があります。

< 参考情報 >

ファンドの年間騰落率
および分配金再投資基準価額の推移

ファンドの運用は平成28年5月13日より開始
する予定であり、該当事項はありません。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較
(2011年3月～2016年2月)



上記グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したのですが、ファンドの騰落率については運用開始前のため該当事項はありません。なお、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

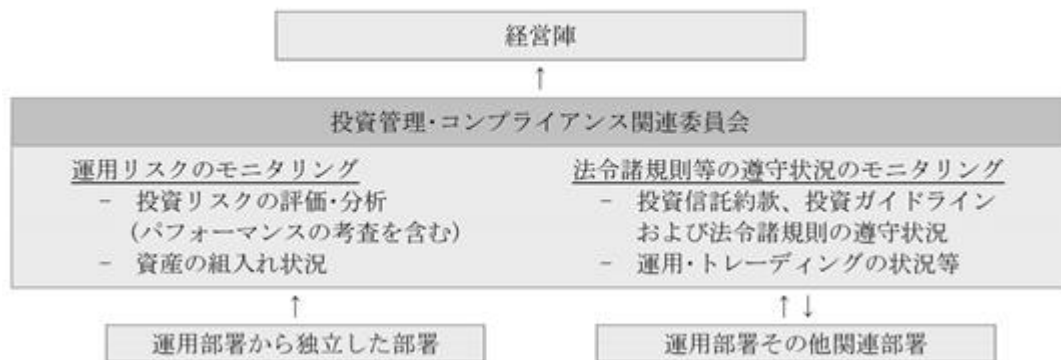
対象期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を代表的な資産クラスについて表示したものです。各資産クラスについては以下の指数に基づき計算しております。

<訂正後>

ファンドの運用におけるリスクの評価・分析(パフォーマンスの考査を含みます。)および資産の組入れの状況等ならびに投資信託約款、投資ガイドライン、法令諸規則の遵守状況および運用・トレーディングの状況等のモニタリングは、運用部署から独立した部署で行います。

モニタリングの結果は、上記部署により定期的に投資管理およびコンプライアンス関連の委員会へ報告されると共に、必要に応じて経営陣へも報告されます。また、問題点等が認識された場合は、すみやかに運用部署その他関連部署へ改善の指示または提案等を行うことにより、適切なファンドのリスク管理を行います。

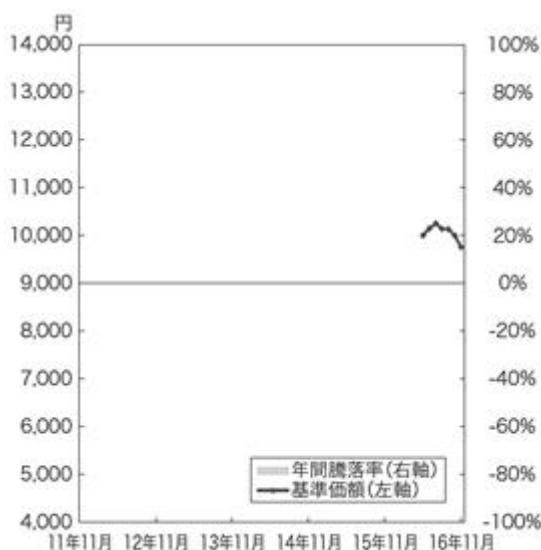
<リスクの管理体制図>



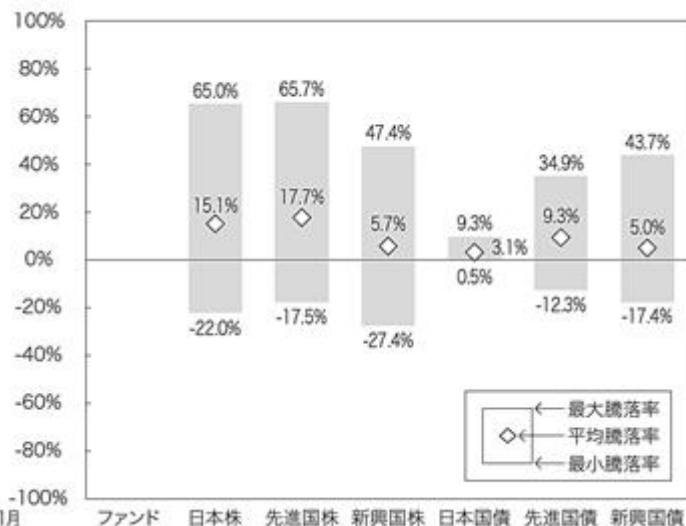
リスクの管理体制は、平成28年12月末日現在のものであり、今後変更される場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較 (2011年12月～2016年11月)



グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、2011年12月～2016年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を代表的な資産クラスについて表示したものです。なお、ファンドの騰落率についてはファンドの運用期間が1年に満たないため表示しておりません。また、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスについては以下の指数に基づき計算しております。

< 後略 >

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

< 前略 >

< 訂正前 >

上記は、平成28年2月末日現在のものですので、税制が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

< 訂正後 >

上記は、平成28年12月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

< 後略 >

5【運用状況】

< 以下の内容に更新します。 >

以下の運用状況は平成28年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	988,216,769	68.33
	ルクセンブルグ	429,316,950	29.68
	小計	1,417,533,719	98.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		28,754,295	1.99
合計(純資産総額)		1,446,288,014	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位銘柄明細

順位	国・地域	種類	銘柄名	数量または 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資信託 受益証券	ビクテ円インカム・セレクト・ファンド (適格機関投資家専用)	1,031,649,201	0.9983	1,029,919,332	0.9579	988,216,769	68.33
2	ルクセンブルグ	投資信託 受益証券	ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイ ティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド クラ ス(H P J P Y) J P Y分配型	69,233.5027	6,650.28	460,422,862	6,201	429,316,950	29.68

b 種類別投資比率

種類	投資比率(%)

投資信託受益証券	98.01
合計	98.01

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成28年11月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末日の純資産の推移は次のとおりです。

期別	純資産総額(百万円)		1万口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
平成28年5月末日	0.535479		10,006	
6月末日	1		10,151	
7月末日	138		10,255	
8月末日	434		10,142	
9月末日	1,133		10,135	
10月末日	1,320		10,002	
11月末日	1,446		9,759	

(注)純資産総額は百万円未満切捨て。分配付きは、各期間末に行われた分配の額を加算しております。

【分配の推移】

期	期間	1万口当たりの分配金(円)
当中間期	平成28年5月13日～平成28年11月12日	円

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
当中間期	平成28年5月13日～平成28年11月12日	2.33

(注)収益率の計算方法：(当期末の基準価額(分配付き) - 設定日の基準価額(分配落ち)) ÷ 設定日の基準価額(分配落ち) × 100

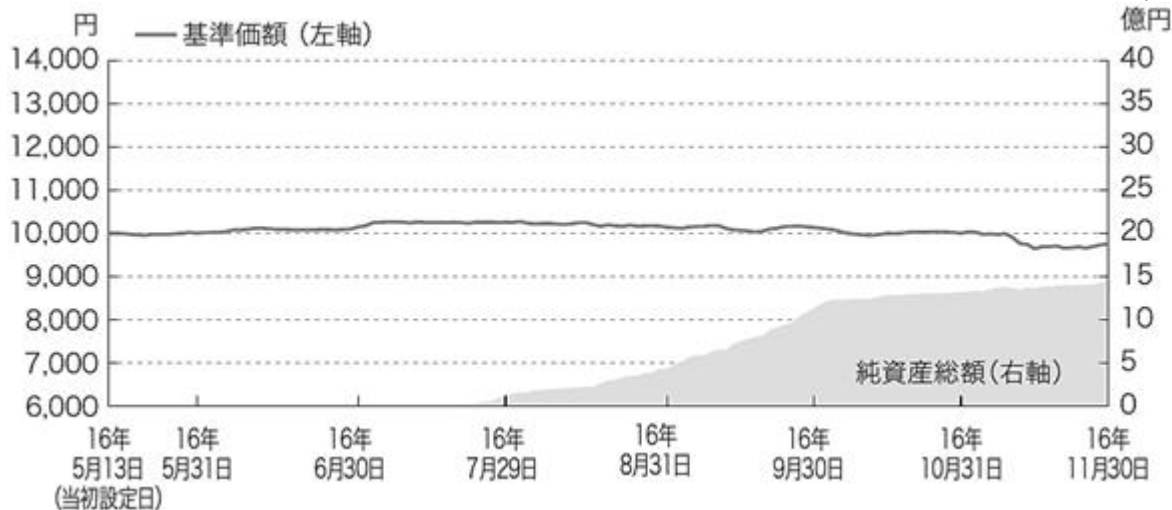
(4) 【設定及び解約の実績】

期	設定口数(口)	解約口数(口)
当中間期	1,390,924,622	9,584,285

(注)設定口数には、当初募集口数を含みます。

<参考情報：運用実績> (2016年11月30日現在)

基準価額・純資産の推移



基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

初回決算日が未到来のため、該当事項はありません。

主要な資産の状況

[資産別構成比]

	資産名	構成比
1	円インカム・セレクト・ファンド	68.3%
2	グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド	29.7%
3	コール・ローン等、その他	2.0%
	合計	100.0%

投資先ファンドの状況

[組入上位5銘柄]

< 債券部分(円インカム・セレクト・ファンド) >

	組入国債	利率	償還日	構成比
1	英国国債	3.750%	2052.07.22	7.2%
2	英国国債	4.250%	2040.12.07	6.9%
3	シンガポール国債	2.500%	2019.06.01	5.9%
4	米国国債	8.750%	2020.08.15	5.6%
5	英国国債	1.500%	2021.01.22	5.4%

構成比は組入債券の合計を100%として計算しています。

< 株式部分(グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド) >

	銘柄名	国名	業種名	構成比
1	ネクステラ・エナジー	米国	電力	4.7%
2	ドミニオン・リソーシズ	米国	総合公益事業	3.9%
3	デューク・エナジー	米国	電力	3.8%
4	エクセロン	米国	電力	3.1%
5	ナショナル・グリッド	英国	総合公益事業	3.0%

構成比は組入株式の合計を100%として計算しています。

年間収益率の推移



2016年は当初設定時(2016年5月13日)以降、11月30日までの騰落率を表示しています。ファンドにはベンチマークはありません。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。最新の運用実績は委託会社のホームページ等で確認することができます。

第3【ファンドの経理状況】

< 以下の内容に更新します。 >

1【財務諸表】

(1) ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間(平成28年5月13日(設定日)から平成28年11月12日まで)の中間財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

ピクテYENアセット・アロケーション・ファンド(1年決算型)

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

第1期中間計算期間
[平成28年11月12日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,835,470
投資信託受益証券	1,324,936,027
未収配当金	5,114,796
流動資産合計	1,353,886,293
資産合計	1,353,886,293
負債の部	
流動負債	
未払金	3,110,000
未払受託者報酬	50,170
未払委託者報酬	1,480,109
未払利息	65
その他未払費用	126,523
流動負債合計	4,766,867
負債合計	4,766,867
純資産の部	
元本等	
元本	1,381,340,337

剰余金

中間剰余金又は中間欠損金（ ）	32,220,911
元本等合計	1,349,119,426
純資産合計	1,349,119,426
負債純資産合計	1,353,886,293

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自 平成28年5月13日 至 平成28年11月12日
営業収益	
受取配当金	23,906,947
有価証券売買等損益	73,286,497
営業収益合計	49,379,550
営業費用	
支払利息	15,154
受託者報酬	50,170
委託者報酬	1,480,109
その他費用	126,523
営業費用合計	1,671,956
営業利益又は営業損失（ ）	51,051,506
経常利益又は経常損失（ ）	51,051,506
中間純利益又は中間純損失（ ）	51,051,506
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	109,877
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,854,859
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,854,859
剰余金減少額又は欠損金増加額	134,141
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	134,141
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	32,220,911

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期中間計算期間 平成28年11月12日現在
1. 元本の推移	
期首元本額	79,150円
期中追加設定元本額	1,390,845,472円
期中一部解約元本額	9,584,285円
2. 受益権の総数	1,381,340,337口
3. 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は32,220,911円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第1期中間計算期間 自 平成28年5月13日 至 平成28年11月12日
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(一口当たり情報に関する注記)

	第1期中間計算期間 (平成28年11月12日現在)
1口当たり純資産額	0.9767円
(1万口当たり純資産額)	(9,767円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

< 参考情報 >

ファンドは、内国証券投資信託である「ピクテ円インカム・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）」の受益証券およびルクセンブルグ籍の外国投資信託である「ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド」のクラス(H P J P Y) J P Y分配型受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、上記の各受益証券です。これら内国証券投資信託および外国投資信託の状況は次のとおりです。なお、記載された情報は監査対象外です。

「ピクテ円インカム・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況

当投資信託は、国内の法律に基づき設定された内国証券投資信託であります。当投資信託は平成28年6月10日に特定期間が終了し、国内において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成されており、独立監査人による財務諸表の監査を受けております。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	前期 [平成27年12月10日現在]	当期 [平成28年6月10日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	-	133,001,350
親投資信託受益証券	14,754,556,709	16,587,176,107
未収入金	5,839,691	-
流動資産合計	14,760,396,400	16,720,177,457
資産合計		
	14,760,396,400	16,720,177,457
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	29,621,583	82,759,570
未払解約金	5,839,691	-
未払受託者報酬	267,876	281,815
未払委託者報酬	8,191,395	8,617,609
未払利息	-	364
その他未払費用	32,896	58,808
流動負債合計	43,953,441	91,718,166
負債合計		
	43,953,441	91,718,166
純資産の部		
元本等		
元本	14,810,791,590	16,551,914,080
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	94,348,631	76,545,211
(分配準備積立金)	128,171,834	65,596,788
元本等合計	14,716,442,959	16,628,459,291
純資産合計		
	14,716,442,959	16,628,459,291
負債純資産合計		
	14,760,396,400	16,720,177,457

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	前期 自 平成27年6月11日 至 平成27年12月10日	当期 自 平成27年12月11日 至 平成28年6月10日
営業収益		
受取利息	-	32
有価証券売買等損益	315,457,523	470,582,733

営業収益合計	315,457,523	470,582,765
営業費用		
支払利息	-	13,111
受託者報酬	1,768,745	1,548,422
委託者報酬	54,086,278	47,349,053
その他費用	214,542	292,075
営業費用合計	56,069,565	49,202,661
営業利益又は営業損失()	259,387,958	421,380,104
経常利益又は経常損失()	259,387,958	421,380,104
当期純利益又は当期純損失()	259,387,958	421,380,104
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	52,454,508	21,515,181
期首剰余金又は期首欠損金()	120,086,801	94,348,631
剰余金増加額又は欠損金減少額	145,772,329	64,482,335
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	123,472,191	23,637,281
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,300,138	40,845,054
剰余金減少額又は欠損金増加額	107,042,895	14,189,225
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,962,604
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	107,042,895	11,226,621
分配金	219,924,714	279,264,191
期末剰余金又は期末欠損金()	94,348,631	76,545,211

(3)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	前期 平成27年12月10日現在	当期 平成28年6月10日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	7,704,207,340円	14,810,791,590円
期中追加設定元本額	19,507,939,171円	5,180,699,400円
期中一部解約元本額	12,401,354,921円	3,439,576,910円
2. 受益権の総数	14,810,791,590口	16,551,914,080口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は94,348,631円であります。	-

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成27年6月11日 至 平成27年12月10日	当期 自 平成27年12月11日 至 平成28年6月10日
1. 主要投資対象である親投資信託受益証券において、信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 当該親投資信託受益証券に係る信託財産の純資産総額のうち、当ファンドに対応する部分の年率0.14%以内の額	1. 主要投資対象である親投資信託受益証券において、信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 同左
2. 分配金の計算過程	2. 分配金の計算過程

第41期 (平成27年6月11日から平成27年7月10日まで)			第47期 (平成27年12月11日から平成28年1月12日まで)		
費用控除後の配当等収益額	A	39,605,870円	費用控除後の配当等収益額	A	39,190,922円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,311,754,289円	収益調整金額	C	1,435,389,597円
分配準備積立金額	D	130,695,967円	分配準備積立金額	D	120,912,008円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,482,056,126円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,595,492,527円
当ファンドの期末残存口数	F	14,369,939,915口	当ファンドの期末残存口数	F	14,605,425,384口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,031.34円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,092.37円
10,000口当たり分配金額	H	20.00円	10,000口当たり分配金額	H	20.00円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	28,739,879円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	29,210,850円
第42期 (平成27年7月11日から平成27年8月10日まで)			第48期 (平成28年1月13日から平成28年2月10日まで)		
費用控除後の配当等収益額	A	53,618,861円	費用控除後の配当等収益額	A	36,417,806円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	32,250,192円
収益調整金額	C	1,407,533,239円	収益調整金額	C	1,305,527,309円
分配準備積立金額	D	141,034,839円	分配準備積立金額	D	113,385,076円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,602,186,939円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,487,580,383円
当ファンドの期末残存口数	F	15,296,150,442口	当ファンドの期末残存口数	F	13,228,609,758口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,047.43円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,124.48円
10,000口当たり分配金額	H	20.00円	10,000口当たり分配金額	H	20.00円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	30,592,300円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	26,457,219円
第43期 (平成27年8月11日から平成27年9月10日まで)			第49期 (平成28年2月11日から平成28年3月10日まで)		
費用控除後の配当等収益額	A	59,576,079円	費用控除後の配当等収益額	A	32,001,201円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	2,170,561,482円	収益調整金額	C	1,460,784,551円
分配準備積立金額	D	163,441,095円	分配準備積立金額	D	155,366,547円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,393,578,656円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,648,152,299円
当ファンドの期末残存口数	F	22,629,079,939口	当ファンドの期末残存口数	F	14,625,416,509口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,057.72円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,126.89円
10,000口当たり分配金額	H	20.00円	10,000口当たり分配金額	H	20.00円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	45,258,159円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	29,250,833円
第44期 (平成27年9月11日から平成27年10月13日まで)			第50期 (平成28年3月11日から平成28年4月11日まで)		
費用控除後の配当等収益額	A	74,568,207円	費用控除後の配当等収益額	A	39,181,565円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	2,270,325,714円	収益調整金額	C	1,582,615,566円
分配準備積立金額	D	166,698,875円	分配準備積立金額	D	155,003,387円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,511,592,796円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,776,800,518円
当ファンドの期末残存口数	F	23,453,290,776口	当ファンドの期末残存口数	F	15,686,062,116口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,070.87円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,132.70円
10,000口当たり分配金額	H	20.00円	10,000口当たり分配金額	H	20.00円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	46,906,581円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	31,372,124円
第45期 (平成27年10月14日から平成27年11月10日まで)			第51期 (平成28年4月12日から平成28年5月10日まで)		
費用控除後の配当等収益額	A	45,480,906円	費用控除後の配当等収益額	A	27,601,119円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,888,262,552円	収益調整金額	C	1,623,562,903円

分配準備積立金額	D	152,184,185円	分配準備積立金額	D	161,908,790円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,085,927,643円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,813,072,812円
当ファンドの期末残存口数	F	19,403,106,121口	当ファンドの期末残存口数	F	16,042,719,076口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,075.03円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,130.14円
10,000口当たり分配金額	H	20.00円	10,000口当たり分配金額	H	50.00円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	38,806,212円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	80,213,595円
第46期 (平成27年11月11日から平成27年12月10日まで)			第52期 (平成28年5月11日から平成28年6月10日まで)		
費用控除後の配当等収益額	A	43,287,137円	費用控除後の配当等収益額	A	40,083,286円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,449,160,163円	収益調整金額	C	1,680,261,855円
分配準備積立金額	D	114,506,280円	分配準備積立金額	D	108,273,072円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,606,953,580円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,828,618,213円
当ファンドの期末残存口数	F	14,810,791,590口	当ファンドの期末残存口数	F	16,551,914,080口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,084.96円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,104.77円
10,000口当たり分配金額	H	20.00円	10,000口当たり分配金額	H	50.00円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	29,621,583円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	82,759,570円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	前期 自 平成27年6月11日 至 平成27年12月10日	当期 自 平成27年12月11日 至 平成28年6月10日
1. 金融商品に対する取組方針	ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を運用の基本方針を含めた信託約款の規定に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	ファンドが保有する主な金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務です。保有する有価証券の詳細は「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 これら金融商品には、市場リスク(価格変動リスク、金利リスク、為替リスク)、信用リスク、流動性リスク等があります。デリバティブ取引等を行った場合は信託約款に記載した目的で取引を行っております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクの管理に係る牽制機能を確保するため、運用リスク管理部門は、運用リスク等に関する状況について、運用リスク管理委員会において定期的に報告を行います。同委員会にはその他の部門からの報告も行われ、運用部門の責任者も交え対応が協議されます。 ・市場リスク 構成銘柄の状況やトラッキングエラー、その他必要に応じて各リスク指標などがチェックされます。 ・信用リスク 平均格付けや格付構成などがチェックされます。 ・流動性リスク 構成銘柄の市場での値付状況等がチェックされます。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日	当期 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金銭債権の決算日後の償還予定額	貸借対照表に計上している金銭債権は、その全額が1年以内に償還され ます。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

前期(平成27年12月10日現在)

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	210,254,965
合計	210,254,965

当期(平成28年 6月10日現在)

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	134,148,512
合計	134,148,512

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(一口当たり情報に関する注記)

	前期 (平成27年12月10日現在)	当期 (平成28年 6月10日現在)
1 口当たり純資産額	0.9936円	1.0046円
(1 万口当たり純資産額)	(9,936円)	(10,046円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4)附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	ビクテ円インカム・セレクト・マザーファンド	12,979,011,039	16,587,176,107	
合計		12,979,011,039	16,587,176,107	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

ファンドは、「ビクテ円インカム・セレクト・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同受益証券です。

なお、同投資信託受益証券の状況は以下の通りです。以下に記載した情報は監査対象外であります。

ビクテ円インカム・セレクト・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	[平成27年12月10日現在]	[平成28年6月10日現在]
資産の部		
流動資産		
預金	111,755,472	14,217,044
コール・ローン	1,269,439,713	3,005,541,193
国債証券	28,217,297,451	40,146,410,012
派生商品評価勘定	209,128,866	259,145,634
未収利息	172,349,637	246,743,168
前払費用	23,188,012	105,032,321
流動資産合計	30,003,159,151	43,777,089,372
資産合計	30,003,159,151	43,777,089,372
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	224,175	3,161,186
未払金	960,292,073	-
未払解約金	8,869,050	80,000
未払利息	-	8,234
その他未払費用	-	91,327
流動負債合計	969,385,298	3,340,747
負債合計	969,385,298	3,340,747
純資産の部		
元本等		
元本	23,465,326,097	34,250,857,657
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,568,447,756	9,522,890,968
元本等合計	29,033,773,853	43,773,748,625
純資産合計	29,033,773,853	43,773,748,625
負債純資産合計	30,003,159,151	43,777,089,372

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、または価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条、61条に基づいて、外貨建取引の記録、及び外貨の売買を処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年12月10日現在	平成28年6月10日現在
1. 元本の推移		
期首相当日現在元本額	13,817,196,414円	23,465,326,097円
期中追加設定元本額	22,148,875,767円	17,693,180,199円
期中一部解約元本額	12,500,746,084円	6,907,648,639円
期末元本額	23,465,326,097円	34,250,857,657円
元本の内訳		
ピクテ円インカム・セレクト・ファンド(毎月分配型)	4,052,291,779円	3,617,864,430円
ピクテ・ゴールド・インカム・ファンド(毎月分配型)	5,117,473円	3,949,492円
ピクテ円インカム・セレクト・ファンド(1年決算型)	5,287,389円	7,150,731円
ピクテ円インカム・セレクト・ファンド2016 - 4 (適格機関投資家専用)	円	9,925,361,284円
ピクテ円インカム・セレクト・ファンド (適格機関投資家専用)	11,924,801,349円	12,979,011,039円
ピクテ円インカム・セレクト・ファンド<分配型>(適格機関投資家専用)	1,816,140,791円	2,158,471,210円
T S U B A S Aピクテ円インカム・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	5,661,687,316円	5,559,049,471円
2. 受益権の総数	23,465,326,097口	34,250,857,657口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成27年6月11日 至 平成27年12月10日	自 平成27年12月11日 至 平成28年6月10日
1. 金融商品に対する取組方針	ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を運用の基本方針を含めた信託約款の規定に基づき行っております。	同左

2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>ファンドが保有する主な金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務です。保有する有価証券の詳細は「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>これら金融商品には、市場リスク(価格変動リスク、金利リスク、為替リスク)、信用リスク、流動性リスク等があります。デリバティブ取引等を行った場合は信託約款に記載した目的で取引を行っております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用リスクの管理に係る牽制機能を確保するため、運用リスク管理部門は、運用リスク等に関する状況について、運用リスク管理委員会において定期的に報告を行います。同委員会にはその他の部門からの報告も行われ、運用部門の責任者も交え対応が協議されます。</p> <p>・市場リスク 構成銘柄の状況やトラッキングエラー、その他必要に応じて各リスク指標などがチェックされます。</p> <p>・信用リスク 平均格付けや格付構成などがチェックされます。</p> <p>・流動性リスク 構成銘柄の市場での値付状況等がチェックされます。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日	自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

4. 金銭債権の決算日後の償還予定額	貸借対照表に計上している金銭債権は、その全額が1年以内に償還されず。	同左
--------------------	------------------------------------	----

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成27年12月10日現在)

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	233,678,899
合計	233,678,899

(平成28年6月10日現在)

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	822,576,712
合計	822,576,712

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(平成27年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	337,968,975	-	337,744,800	224,175
	イギリスポンド	337,968,975	-	337,744,800	224,175
	売建	28,169,890,566	-	27,960,761,700	209,128,866
	米ドル	8,759,218,614	-	8,641,252,000	117,966,614
	イギリスポンド	9,272,278,855	-	9,252,853,100	19,425,755
	シンガポールドル	10,138,393,097	-	10,066,656,600	71,736,497
	合計	28,507,859,541	-	28,298,506,500	208,904,691

(平成28年6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	売建	40,820,933,661	-	40,564,949,213	255,984,448
	米ドル	13,762,068,449	-	13,555,213,313	206,855,136
	スウェーデンクローネ	12,863,096,585	-	12,813,435,900	49,660,685
	シンガポールドル	14,195,768,627	-	14,196,300,000	531,373
	合計	40,820,933,661	-	40,564,949,213	255,984,448

(注)時価の算定方法

・為替予約取引

1. 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

(1) 予約為替の受渡日(以下、当該日という。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値を元に算出したレートにより評価しております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。

2. 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(一口当たり情報に関する注記)

	(平成27年12月10日現在)	(平成28年6月10日現在)
1口当たり純資産額	1.2373円	1.2780円
(1万口当たり純資産額)	(12,373円)	(12,780円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	2.375% US TREASURY N/B 24/08/15	14,500,000.00	15,380,150.00	
		2% US TREASURY N/B 21/02/28	9,600,000.00	9,949,440.00	
		4.75% US TREASURY N/B 41/02/15	14,330,000.00	20,890,274.00	
		4% US TREASURY N/B 18/08/15	19,530,000.00	20,920,536.00	
		5.375% US TREASURY N/B 31/02/15	330,000.00	479,028.00	
		6.125% US TREASURY N/B 27/11/15	760,000.00	1,103,596.00	
		7.25% US TREASURY N/B 22/08/15	14,140,000.00	19,073,446.00	
		8.75% US TREASURY N/B 17/05/15	1,740,000.00	1,871,022.00	
		8.75% US TREASURY N/B 20/08/15	15,870,000.00	20,808,744.00	
		8.875% US TREASURY N/B 19/02/15	8,490,000.00	10,302,615.00	
	米ドル 小計		99,290,000.00	120,778,851.00 (12,935,414,942)	
	スウェーデンクローネ	1% SWEDISH GOVT 26/11/12	47,000,000.00	49,133,800.00	
		2.5% SWEDISH GOVT 25/05/12	198,000,000.00	235,857,600.00	
		3.5% SWEDISH GOVT 22/06/01	135,800,000.00	164,562,440.00	
		3.5% SWEDISH GOVT 39/03/30	94,600,000.00	132,345,400.00	
		3.75% SWEDISH GOVT 17/08/12	38,000,000.00	39,941,800.00	
		4.25% SWEDISH GOVT 19/03/12	119,000,000.00	134,719,900.00	
		5% SWEDISH GOVT 20/12/01	182,000,000.00	225,498,000.00	
	スウェーデンクローネ 小計		814,400,000.00	982,058,940.00 (12,835,510,345)	

シンガポールドル	2.25% SINGAPORE GOVT 21/06/01	29,300,000.00	30,407,540.00	
	2.375% SINGAPORE GOVT 17/04/01	17,700,000.00	17,931,870.00	
	2.5% SINGAPORE GOVT 19/06/01	39,350,000.00	40,994,830.00	
	2.75% SINGAPORE GOVT 42/04/01	16,300,000.00	17,489,900.00	
	2.875% SINGAPORE GOVT 30/09/01	26,900,000.00	28,982,060.00	
	3.25% SINGAPORE GOVT 20/09/01	15,000,000.00	16,212,000.00	
	3% SINGAPORE GOVT 24/09/01	27,300,000.00	29,696,940.00	
シンガポールドル 小計		171,850,000.00	181,715,140.00 (14,375,484,725)	
合計			40,146,410,012 (40,146,410,012)	

(注)

- 各通貨毎の小計欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
- 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算の合計額であり内数で表示してあります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計額に対する比率
米ドル	国債証券 10銘柄	100.0%	32.2%
スウェーデンクローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	32.0%
シンガポールドル	国債証券 7銘柄	100.0%	35.8%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

**「ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド
グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド」の状況**

当投資信託は、ルクセンブルグの法律に基づき設立された外国投資信託であります。当投資信託は、2016年6月30日付で、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した中間財務書類が作成されております。中間計算期間末のため独立監査人による財務書類の監査は受けておりません。以下の「純資産計算書」、「運用計算書および純資産変動計算書」ならびに「投資有価証券およびその他の純資産明細表」等は、原文の中間財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものであり、「ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド クラス(H P J P Y) J P Y分配型」を含むすべてのクラスが対象となっております。

ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド
グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド

純資産計算書
2016年6月30日現在

(単位：米ドル)

資産	
投資有価証券取得原価	59,195,717.21
投資に係る未実現純利益 / 損失	5,148,967.63
投資有価証券時価評価額(注1)	64,344,684.84
現金預金(注1)	1,086,546.21
為替予約取引に係る未実現純利益(注1 g, 6)	1,594,348.02
	67,025,579.07
負債	
未払管理報酬および投資顧問報酬(注3)	20,112.60
未払年次税(注2)	1,651.88
その他の未払報酬(注4)	14,366.28
	36,130.76
2016年6月30日現在純資産合計	66,989,448.31
2015年12月31日現在純資産合計	44,822,466.57
2014年12月31日現在純資産合計	68,344,929.42

運用計算書および純資産変動計算書
2016年6月30日に終了した期間

(単位：米ドル)

期首現在純資産額	44,822,466.57
収益	
配当金、純額(注1.f)	1,342,064.69
預金利息	117.63
	1,342,182.32
費用	
管理報酬および投資顧問報酬(注3)	122,054.13
保管報酬、銀行手数料および利息	324,390.18
管理事務費用、サービス報酬、監査費用およびその他の費用	44,379.59
年次税(注2)	3,357.48
取引費用(注1.h)	88,995.21
	583,176.59
投資純利益 / (損失)	759,005.73
投資対象売却に係る実現純利益 / (損失)(注8)	(6,105,708.07)
外国為替に係る実現純損失	(278,121.34)
為替予約取引に係る実現純利益 / (損失)	6,257,226.54
実現純利益 / (損失)	632,402.86
以下に係る未実現純評価利益 / (損失)の変動：	

- 投資有価証券(注9)	5,192,191.61
- 為替予約取引	1,608,843.78
運用による純資産の増加/(減少)	7,433,438.25
受益証券発行手取額	46,751,729.24
受益証券買戻費用	(31,478,266.29)
分配金支払(注7)	(5,753,165.01)
再評価差額*	5,213,245.55
期間末現在純資産額	66,989,448.31

* 上記の差額は、2015年12月31日と2016年6月30日におけるサブファンドの通貨以外の通貨建の株式をサブファンドの通貨へ換算したことに関連する項目への為替相場の変動の影響によるものです。

投資有価証券およびその他の純資産明細表

2016年6月30日現在

(単位:米ドル)

銘柄	数量	時価(注1)	純資産に 対する 比率(%)
・ 公認の金融商品取引所に上場されているまたは他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券			
株式			
オーストラリア			
APA GROUP	127,883.00	879,730.75	1.31
TELSTRA	102,320.00	423,545.73	0.63
		1,303,276.48	1.94
バミューダ			
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDING	95,000.00	816,571.91	1.22
		816,571.91	1.22
ブラジル			
CPFL ENERGIA	32,732.00	207,359.39	0.31
SABESP	28,900.00	258,523.47	0.39
TELEFONICA BRASIL PFD	30,000.00	402,824.55	0.60
TRACTEBEL ENERGIA	23,200.00	274,432.21	0.41
		1,143,139.62	1.71
カナダ			
BCE	4,076.00	191,845.04	0.29
		191,845.04	0.29
チリ			
ENDESA	411,966.00	375,593.31	0.56
ENDESA AMERICAS	446,012.00	205,079.32	0.31
ENERSIS AMERICA	1,271,381.00	216,677.61	0.32
		797,350.24	1.19
フランス			
ENGIE	68,022.00	1,090,335.78	1.63
SUEZ	32,324.00	507,336.13	0.76
VEOLIA ENVIRONNEMENT	37,704.00	816,027.20	1.22
		2,413,699.11	3.61
ドイツ			
DEUTSCHE TELEKOM REG.	21,028.00	354,025.46	0.53
E.ON	29,651.00	295,066.68	0.44
		649,092.14	0.97
香港			
CLP HOLDINGS	119,000.00	1,211,487.81	1.81
POWER ASSETS HOLDING	85,000.00	778,265.90	1.16

		1,989,753.71	2.97
インドネシア			
PERUSAHAAN GAS NEGARA 'B'	553,800.00	98,081.84	0.15
TELEKOMUNIKASI INDONESIA 'B'	2,868,400.00	864,057.34	1.29
		962,139.18	1.44
イスラエル			
BEZEQ ISRAEL TELECOMMUNICATION	326,293.00	647,287.90	0.97
		647,287.90	0.97
イタリア			
ATLANTIA	22,418.00	551,547.87	0.82
ENEL	384,820.00	1,678,577.14	2.51
SNAM	144,880.00	853,634.59	1.27
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE	97,724.00	532,620.18	0.80
		3,616,379.78	5.40
日本			
KDDI CORP	57,900.00	1,752,566.83	2.62
NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	32,200.00	1,502,844.38	2.24
SHIKOKU ELECTRIC POWER	9,200.00	107,882.76	0.16
		3,363,293.97	5.02
マレーシア			
TELEKOM MALAYSIA	205,800.00	345,594.94	0.52
		345,594.94	0.52
オランダ			
KONINKLIJKE KPN NV	198,596.00	713,348.29	1.06
		713,348.29	1.06
ポルトガル			
EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL	191,072.00	581,928.26	0.87
		581,928.26	0.87
韓国			
KOREA ELECTRIC POWER	19,865.00	1,041,666.91	1.55
		1,041,666.91	1.55
スペイン			
ENDESA	14,473.00	286,021.79	0.43
IBERDROLA	316,565.00	2,108,966.88	3.15
RED ELECTRICA	10,033.00	885,211.06	1.32
		3,280,199.73	4.90
スイス			
SWISSCOM	359.00	175,377.26	0.26
		175,377.26	0.26
台湾			
CHUNGHWA TELECOM	184,000.00	664,496.70	0.99
		664,496.70	0.99
タイ			
ADVANCED INFO SERVICE -FGN-	72,000.00	323,733.64	0.48
INTOUCH HOLDINGS -NVDR-	196,935.00	304,033.13	0.45
		627,766.77	0.93
イギリス			
CENTRICA	351,599.00	1,043,063.71	1.56
INMARSAT	38,096.00	410,364.32	0.61
NATIONAL GRID	119,399.00	1,728,512.11	2.58
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	51,147.00	1,042,054.66	1.56

SEVERN TRENT	16,378.00	526,180.46	0.79
UNITED UTILITIES GROUP	42,918.00	590,435.97	0.88
VODAFONE GROUP	76,131.00	226,825.04	0.34
		5,567,436.27	8.32
アメリカ合衆国			
AES	47,418.00	570,438.54	0.85
ALLIANT ENERGY	12,477.00	496,834.14	0.74
AMEREN CORPORATION	12,754.00	671,243.02	1.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,566.00	1,552,540.80	2.32
AMERICAN WATER WORKS	4,154.00	343,390.41	0.51
CENTERPOINT ENERGY	14,654.00	350,084.06	0.52
CMS ENERGY	14,902.00	670,142.94	1.00
COLUMBIA PIPELINE GROUP	22,293.00	568,248.57	0.85
CSX	31,685.00	805,432.70	1.20
DOMINION RESOURCES	31,764.00	2,429,628.36	3.63
DTE ENERGY	9,342.00	911,312.10	1.36
DUKE ENERGY	31,713.00	2,669,600.34	3.98
EDISON INTERNATIONAL	17,119.00	1,300,359.24	1.94
ENTERGY	7,717.00	612,112.44	0.91
EVERSOURCE ENERGY	17,769.00	1,043,217.99	1.56
EXELON	44,735.00	1,564,382.95	2.34
FIRSTENERGY	26,565.00	906,397.80	1.35
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA 'A'	7,858.00	252,084.64	0.38
ITC HOLDINGS	20,933.00	968,988.57	1.45
NEXTERA ENERGY	22,669.00	2,895,964.75	4.31
NISOURCE	12,575.00	327,578.75	0.49
OGE ENERGY	8,928.00	286,231.68	0.43
PG & E	28,652.00	1,800,205.16	2.69
PINNACLE WEST CAPITAL	6,267.00	497,286.45	0.74
PPL	38,750.00	1,441,500.00	2.15
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP	25,938.00	1,176,288.30	1.76
SEMPRA ENERGY	13,460.00	1,506,577.80	2.25
SOUTHERN COMPANY	26,330.00	1,376,532.40	2.05
UNION PACIFIC	7,058.00	603,247.26	0.90
VENTAS	4,590.00	330,158.70	0.49
WEC ENERGY GROUP	16,560.00	1,063,152.00	1.59
XCEL ENERGY	25,296.00	1,111,253.28	1.66
		33,102,416.14	49.40
合計		63,994,060.35	95.53
その他の譲渡可能な有価証券			
株式			
カナダ			
TRANSCANADA -SUB. REC.-	7,826.00	350,624.49	0.52
		350,624.49	0.52
合計		350,624.49	0.52
投資有価証券合計		64,344,684.84	96.05
現金預金		1,086,546.21	1.62
その他の純資産		1,558,217.26	2.33
純資産合計		66,989,448.31	100.00

中間財務書類に対する注記(2016年6月30日現在)(抜粋)

注1 - 重要な会計方針の要約a) 一般事項

当中間財務書類は、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則および同国において適用される法定の報告要件にしたがい表示されています。

ファンドの目論見書において規定されているとおり、各クラスの受益証券の純資産価格は各取引日において管理会社により算定されます。各サブファンドの取引日は以下のとおりです。

ルクセンブルグ、英国および日本の銀行営業日である日：

- ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド

b) 各サブファンドの外国通貨換算

サブファンドの基準通貨以外の通貨建ての現金預金、その他の純資産および投資有価証券の時価評価額は、当期間末現在の実勢為替レートでサブファンドの基準通貨に換算されます。

サブファンドの基準通貨以外の通貨建ての収益および費用は、取引日の実勢為替レートでサブファンドの基準通貨に換算されます。

発生する為替差損益は、運用計算書および純資産変動計算書に含まれています。

c) 資産の評価

- (1) 金融商品取引所に上場されている有価証券または他の規制ある市場で取引されている有価証券は、係る取引所または市場における入手可能な最終の価格で評価されます。有価証券が複数の金融商品取引所または市場で取引されている場合には、係る有価証券の主要市場である金融商品取引所または市場における入手可能な最終の価格により決定されます。
- (2) 金融商品取引所に上場されていない有価証券または他の規制ある市場で取引されていない有価証券は、入手可能な直近の取引値で評価されます。
- (3) 取引値が入手できない有価証券または(1)および/または(2)に記載される価格が公正な市場価格を反映していない有価証券は、管理会社の取締役会により合理的に予想される売却価格に基づき、慎重かつ誠実な立場から評価されます。
- (4) 短期流動資産は、償却原価法で評価されます。
- (5) オープンエンド型投資信託の受益証券/投資証券は直近の取得可能な1口当たり純資産価格に基づき評価されます。当該価格が公正価値を表していない場合、取締役会が公正かつ慎重に価格を決定します。
- (6) 規制市場、EU域外の金融商品取引所または他の規制のある市場において上場または取引されていない、残存期間が12ヵ月以内の短期金融商品は、額面に経過利息を加えた額で評価され、合計評価額は償却原価法で処理されます。
- (7) 手元現金または現金預金、要求払債券および手形ならびに未収金、前払費用、宣言されたまたは発生済みであるが未受領の配当金および利息は、額面価額が入手可能でないと考えられる場合を除き、額面価額で評価されます。額面価額が入手可能でないと考えられる場合には、係る評価額は、これらの資産の実質価額を反映するために管理会社の取締役会が判断した金額を控除することにより決定されます。

d) 投資有価証券に係る実現純損益

有価証券売却に係る実現損益は、平均原価に基づき計算され、運用計算書および純資産変動計算書に含まれます。

e) 組入る有価証券の取得原価

サブファンドの基準通貨以外の通貨建ての有価証券の取得原価は、取得日の実勢為替レートで計算されます。

f) 収益

配当金は、落ち日に源泉徴収後の金額で計上されます。利息は、発生基準で計上されます。

g) 為替予約取引の評価

未決済の為替予約取引から発生する未実現純損益は、評価日において同日現在適用される先渡為替価格を基準に決定されます。

h) 取引費用

取引費用は、投資有価証券の購入および売却に関連する各サブファンドにより生じた費用を表します。

これらの費用は、仲介手数料、銀行手数料、税金、預託報酬およびその他の取引費用を含み、2016年6月30日に終了する期間の運用計算書および純資産変動計算書に含まれます。

注2 - 年次税

ルクセンブルグにおける現行法規にしたがい、ファンドは、いかなる所得税も課せられません。ファンドは、その純資産に対して、四半期毎に支払われ、各四半期末現在の純資産に基づいて計算される年次税(年率0.05%)を課せられます。係る税金は、機関投資家に受益者が限定されるクラス受益証券に帰属する純資産に関しては、0.01%の料率まで減じられます。ルクセンブルグにおける他の契約型投資信託の受益証券/投資証券に投資される純資産額については、本年次税を免除されます。ただし、係る受益証券/投資証券が既に本年次税を課せられている場合に限りです。

注3 - 管理報酬および投資顧問報酬

管理会社は、各サブファンドの資産から、各サブファンド/クラスに帰属する平均純資産額を基準に以下の比例料率で計算される報酬を受領する権利を有します。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド：

- クラス(H P J P Y) J P Y分配型受益証券：年率0.35%

投資顧問会社への報酬は、管理会社により負担されます。

注4 - その他の未払報酬

2016年6月30日現在、その他の未払報酬には、主に保管報酬、管理事務報酬、販売会社報酬および代行協会員報酬が含まれています。

注5 - 申込手数料および買戻手数料

販売会社に対する申込手数料が、一口当たり純資産額の最高3%(税別)で計算され、請求されることがあります。

以下の受益証券には、申込手数料は課せられません。

- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド すべてのクラスの受益証券

各サブファンドの受益証券は、1口当たり純資産額で買戻されます。買戻手数料は課せられません。

一定の状況下において、管理会社は、ファンドの目論見書に定義される「解約留保金」を課することができます。その場合、解約留保金は、受益証券1口当たり純資産額の2%を超過してはなりません。

注6 - 為替予約取引

下記の同一の通貨ペアにかかる為替予約取引は合算されています。満期日までの年限が最長の取引のみが表示されています。

2016年6月30日現在、以下の為替予約取引が未決済でした。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジド・ファンド

通貨	購入	通貨	売却	満期日
AUD	12,059,683.88	USD	8,920,467.92	2016/07/29
BRL	48,966,014.74	USD	13,631,198.09	2016/09/16
CAD	1,134,500.00	USD	873,011.76	2016/07/15
EUR	3,743,800.00	USD	4,210,772.31	2016/07/15
GBP	757,600.00	USD	1,052,336.70	2016/07/15
HKD	3,979,800.00	USD	513,181.52	2016/07/15
JPY	3,633,931,664.00	USD	35,529,901.94	2016/07/29
MXN	6,075,616.16	USD	320,207.45	2016/07/29
THB	2,022,600.00	USD	57,341.40	2016/08/15
TRY	675,757.14	USD	231,067.58	2016/07/29
USD	1,532,553.97	AUD	2,083,600.00	2016/09/16
USD	1,923,524.37	BRL	6,823,947.87	2016/09/16
USD	1,467,054.66	CAD	1,888,400.00	2016/09/16
USD	266,866.97	CHF	256,300.00	2016/09/16
USD	816,753.61	CLP	558,499,300.00	2016/09/16
USD	15,129,065.33	EUR	13,264,000.00	2016/09/16
USD	6,955,933.91	GBP	4,805,800.00	2016/09/16
USD	3,292,269.91	HKD	25,542,400.00	2016/09/19
USD	1,025,317.45	IDR	13,767,312,100.00	2016/09/16
USD	723,568.76	ILS	2,740,600.00	2016/09/19
USD	4,186,798.14	JPY	452,180,600.00	2016/09/16
USD	1,064,846.19	KRW	1,244,369,700.00	2016/09/21
USD	311,988.88	MYR	1,217,000.00	2016/07/15
USD	775,625.22	THB	27,306,400.00	2016/09/16
USD	775,189.24	TWD	25,294,000.00	2016/09/20

USD	414,023.83	ZAR	6,258,000.00	2016/09/16
ZAR	22,546,618.73	USD	1,468,211.20	2016/08/12

2016年6月30日現在のこれらの契約に係る未実現純利益は、1,594,348.02米ドルであり、純資産計算書に含まれていません。

注7 - 分配金の支払

2016年1月1日から2016年6月30日までの期間中、以下の分配金が支払われました。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・カレンシー・ヘッジ
ド・ファンド クラス(H P J P Y) J P Y分配型受益証券

2016年1月	1口当たり80円
2016年2月	1口当たり80円
2016年3月	1口当たり80円
2016年4月	1口当たり80円
2016年5月	1口当たり80円
2016年6月	1口当たり80円

注8 - 投資対象売却に係る実現利益 / 損失の詳細

2016年1月1日から2016年6月30日までの期間の投資対象売却に係る実現利益 / 損失の詳細は、以下のとおりです。

	実現利益	実現損失	実現純利益 / (損失)
USD	4,528,076.52	(10,633,784.59)	(6,105,708.07)

注9 - 投資有価証券に係る未実現利益 / 損失の変動の詳細

2016年1月1日から2016年6月30日までの期間の投資対象に係る未実現利益 / 損失の変動の詳細は、以下のとおりです。

	未実現利益の変動	未実現損失の変動	未実現純利益 / (損失)の変動
USD	6,159,813.57	(967,621.96)	5,192,191.61

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成28年11月30日現在です。

【純資産額計算書】

資産総額	1,448,419,957円
負債総額	2,131,943円
純資産総額(-)	1,446,288,014円
発行済口数	1,482,029,340口
1万口当たり純資産額(/)	9,759円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1)資本金の額

平成28年2月末日現在：2億円

<訂正後>

(1)資本金の額

平成28年12月末日現在：2億円

<後略>

2【事業の内容及び営業の概況】

<前略>

<訂正前>

平成28年2月末日現在、委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額は次のとおりです(ただし、マザーファンドを除きます)。

種類			本数	純資産総額(円)
追加型投資信託	国内	株式	7	13,617,144,971
		株式	10	376,644,460,569
	海外	インデックス型	2	662,801,132
		債券	15	116,418,332,905
		株式	22	900,886,348,078
	内外	債券	7	30,080,391,911
		資産複合	15	99,652,322,643
単体型投資信託	海外	債券	1	9,997,288,875
	内外	株式	1	1,428,504,342
		資産複合	1	3,378,867,779
合計			81	1,552,766,463,205

<訂正後>

平成28年12月末日現在、委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額は次のとおりです(ただし、マザーファンドを除きます)。

種類			本数	純資産総額(円)
追加型投資信託	国内	株式	7	15,061,671,312
		株式	11	316,657,611,641
	海外	インデックス型	2	948,722,768
		債券	14	80,215,232,729
		その他資産	1	2,275,344,841
	内外	株式	29	801,969,625,585
		債券	8	38,380,433,711
資産複合		16	114,118,256,430	
単体型投資信託	海外	債券	3	18,449,985,349
	内外	株式	2	3,265,287,842
		債券	4	26,894,078,665
		資産複合	1	3,441,567,477

合計	98	1,421,677,818,350
----	----	-------------------

< 後略 >

3【委託会社等の経理状況】

<以下のとおり中間財務諸表に関して追加します。>

(1)財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

当社の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目、その他の事項の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2)監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度(平成27年1月1日から平成27年12月31日まで)の財務諸表について、PWCあらた監査法人の監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度の中間会計期間(平成28年1月1日から平成28年6月30日まで)の中間財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人の中間監査を受けております。

財務諸表

<中略>

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第32期中間会計期間末 平成28年6月30日
資産の部		
流動資産		
現金・預金		1,427,237
未収委託者報酬		1,191,296
未収収益		130,552
繰延税金資産		263,544
その他		196,101
流動資産合計		3,208,732
固定資産		
有形固定資産	1	352,606
無形固定資産		38,346
投資その他の資産		
投資有価証券		14,705
長期差入保証金		283,788
繰延税金資産		385,941
投資その他の資産合計		684,434
固定資産合計		1,075,387
資産合計		4,284,119

負債の部		
流動負債		
未払金		1,032,846
未払法人税等		10,423
賞与引当金		397,843
その他	2	60,725
流動負債合計		1,501,839
固定負債		
退職給付引当金		317,597
資産除去債務		81,055
固定負債合計		398,653
負債合計		1,900,492
純資産の部		
株主資本		
資本金		200,000
利益剰余金		
利益準備金		50,000
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		2,131,904
利益剰余金合計		2,181,904
株主資本合計		2,381,904
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,722
評価・換算差額等合計		1,722
純資産合計		2,383,626
負債純資産合計		4,284,119

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第32期中間会計期間	
	自 平成28年 1月 1日	
	至 平成28年 6月30日	
営業収益		
委託者報酬		8,071,452
その他営業収益		266,623
営業収益計		8,338,076
営業費用及び一般管理費	1	7,953,292
営業利益		384,783
営業外収益		1,303
営業外費用		10,529
経常利益		375,557
特別損失		184
税引前中間純利益		375,373
法人税、住民税及び事業税		1,118
法人税等還付税額		40,316

法人税等調整額	116,821
中間純利益	297,750

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間(自 平成28年 1月 1日 至平成28年 6月30日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	利益剰余金		利益 剰余金 合計		その他 有価証券 評価 差額金	評価・換算 差額等 合計	
		利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金					
当期首残高	200,000	50,000	1,834,153	1,884,153	2,084,153	2,912	2,912	2,087,066
当中間期変動額								
中間純利益			297,750	297,750	297,750			297,750
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)						1,190	1,190	1,190
当中間期変動額合計	-	-	297,750	297,750	297,750	1,190	1,190	296,560
当中間期末残高	200,000	50,000	2,131,904	2,181,904	2,381,904	1,722	1,722	2,383,626

重要な会計方針

区分	第32期中間会計期間 自 平成28年 1月 1日 至 平成28年 6月30日
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 (1) その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直 入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用してお ります。
2. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定額法により償却しております。 (2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法により償却しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能 期間(5年)に基づく定額法により償却しております。
3. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換 算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算 し、換算差額は損益として処理しております。

4．引当金の計上基準	<p>(1)貸倒引当金 債権等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により算出した額を計上しております。貸倒懸念債権等はありません。</p> <p>(2)賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払いに充てるため、支出見込額の当中間会計期間負担分を計上しております。</p> <p>(3)退職給付引当金 役員及び従業員の退職金に充てるため、当中間会計期間末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異は、その発生年度に一括損益処理しています。</p>
5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1)消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

区分	第32期中間会計期間末 (平成28年6月30日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額	515,240千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

区分	第32期中間会計期間 自 平成28年1月1日 至 平成28年6月30日	
1 減価償却実施額	有形固定資産	22,979千円
	無形固定資産	9,746千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間(自 平成28年1月1日 至 平成28年6月30日)

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

	第32期事業年度期首 株式数 (株)	第32期中間会計期間 増加株式数 (株)	第32期中間会計期間 減少株式数 (株)	第32期中間会計期間末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	800	-	-	800
合計	800	-	-	800

2．配当に関する事項

(1)配当金支払額

該当事項はありません。

(2)基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第32期中間会計期間(自 平成28年1月1日 至 平成28年6月30日)

1. ファイナンス・リース取引

該当事項はありません。

2. オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内 275,271千円

1年超 737,864千円

合計 1,013,135千円

(金融商品関係)

第32期中間会計期間末(平成28年6月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

1. 平成28年6月30日における金融商品の中間貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額は次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,427,237	1,427,237	-
(2)未収委託者報酬	1,191,296	1,191,296	-
資産計	2,618,533	2,618,533	-
(1)未払金	1,032,846	1,032,846	-
負債計	1,032,846	1,032,846	-

2. 金融商品の時価の算定方法

現金・預金、未収委託者報酬及び未払金

これらは短期決済されるものなので、時価は帳簿価額にほぼ等しくなっております。したがって時価は当該帳簿価額によっております。

3. 長期差入保証金(貸借対照表計上額283,788千円)は、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末(平成28年6月30日現在)

その他有価証券で時価のあるもの

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額(千円)
		(千円)	(千円)	
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	7,015	4,000	3,015
	小計	7,015	4,000	3,015
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託受益証券	7,690	8,132	442
	小計	7,690	8,132	442
合計		14,705	12,132	2,573

(デリバティブ取引関係)

第32期中間会計期間末(平成28年6月30日現在)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

第32期中間会計期間末(平成28年6月30日現在)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度期首	80,912千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	-
時の経過による調整額	142千円
資産除去債務の履行による減少額	-
当中間会計期間末残高	81,055千円

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

第32期中間会計期間(自 平成28年1月1日 至 平成28年6月30日)

当社は、投資運用業及び投資助言代理業の単一セグメントを報告セグメントとしております。

従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

2. 関連情報

第32期中間会計期間(自 平成28年1月1日 至 平成28年6月30日)

(1) 製品及びサービスごとの情報

	投資信託委託業	投資顧問業	その他	合計
外部顧客への営業収益	8,071,452千円	167,187千円	99,436千円	8,338,076千円

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦外部顧客への営業収益が営業収益総額の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一顧客が存在しないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

	第32期中間会計期間 自 平成28年1月1日 至 平成28年6月30日
1株当たり純資産額	2,979,533円41銭
1株当たり中間純利益	372,188円56銭
中間損益計算書上の中間純利益	297,750千円
1株当たり中間純利益の算定に用いられた 普通株式にかかる中間純利益	297,750千円
差額	-
期中平均株式数	
普通株式	800株

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権付社債等潜在株式がないため記載していません。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1)受託会社

< 中略 >

平成27年3月末日現在

<再信託受託会社の概要>

< 中略 >

平成27年3月末日現在

< 中略 >

(2)販売会社

名称	資本金の額	事業の内容
楽天証券株式会社	7,495百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

平成27年3月末日現在

<訂正後>

(1)受託会社

< 中略 >

平成28年3月末日現在

<再信託受託会社の概要>

< 中略 >

平成28年3月末日現在

< 中略 >

(2)販売会社

名称	資本金の額	事業の内容
楽天証券株式会社	7,495百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社広島銀行 株式会社秋田銀行	54,573百万円 14,100百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

平成28年3月末日現在

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月13日

ピクテ投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員
公認会計士
鶴田 光夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているピクテ投信投資顧問株式会社の平成28年1月1日から平成28年12月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年1月1日から平成28年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ピクテ投信投資顧問株式会社の平成28年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年1月1日から平成28年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月21日

ピクテ投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているピクテYENアセット・アロケーション・ファンド(1年決算型)の平成28年5月13日から平成28年11月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ピクテYENアセット・アロケーション・ファンド(1年決算型)の平成28年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(平成28年5月13日から平成28年11月12日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

ピクテ投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。