

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成30年 5月18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・セキュリティ・ファンド(為替ヘッジあり)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金 額】	当初自己設定：100万円とします。 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、有価証券報告書を提出しましたので、平成29年7月5日付をもって提出した有価証券届出書の記載事項のうち、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

- a 主に世界のセキュリティ関連企業の株式に投資します

<中略>

特定の銘柄、国や通貨に集中せず分散投資を基本としリスク分散を図ります。

<中略>

<マザーファンドの投資プロセス>

<中略>

投資プロセスは、平成29年5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>

ファンドの特色

- a 主に世界のセキュリティ関連企業の株式に投資します

<中略>

特定の銘柄、国や通貨に集中せず分散投資を基本としリスク分散を図ります。

<中略>

<マザーファンドの投資プロセス>

<中略>

投資プロセスは、平成30年3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。

<後略>

(2)【ファンドの沿革】**<訂正前>**

平成29年7月24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29年7月24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29年5月末日現在)

<訂正後>

委託会社の概況(平成30年3月末日現在)

<後略>

2【投資方針】**(3)【運用体制】**

<前略>

<訂正前>

運用体制は、平成29年5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>

運用体制は、平成30年3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】

< 中略 >

< 訂正前 >

(2) リスクの管理体制

< 中略 >

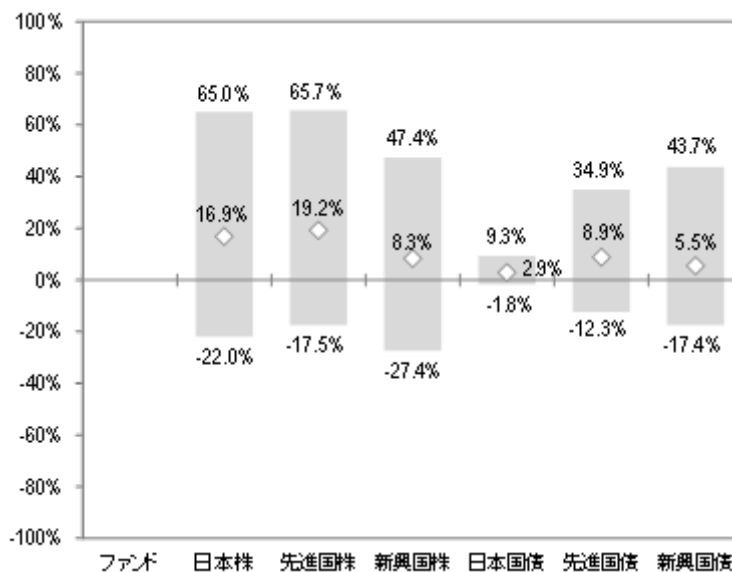
リスクの管理体制は、平成29年5月末日現在のものであり、今後変更される場合があります。

< 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
(2012年5月～2017年4月)

ファンドの運用は2017年7月24日より
開始する予定であり、該当事項はありませ
ん。



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。

2012年5月～2017年4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。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。

< 各資産クラスの指数 >

< 中略 >

先進国債 シティ世界国債指数(除く日本、円換算)

< 中略 >

上記各指数について

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)：東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とし、浮動株ベースの時価総額加重型で算出された指数で、同指数に関する知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)に帰属します。東証は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東証は同指数の算出もしくは公表方法の変更、同指数の算出もしくは公表の停止または同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。MSCIコクサイ指数(税引前配当込み)：MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。MSCIエマージング・マーケット指数(税引前配当込み)：MSCIエマージング・マーケット指数とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。NOMURA-BPI国債：NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。同指数の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また同社は同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果に関して一切責任を負いません。シティ世界国債指数(除く日本)：シティ世界国債指数(除く日本)とは、Citigroup Index LLCにより設計、算出、公表されている指数であり、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券指数です。JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド：JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドとは、J.P.Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的な指数です。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。同指数の著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

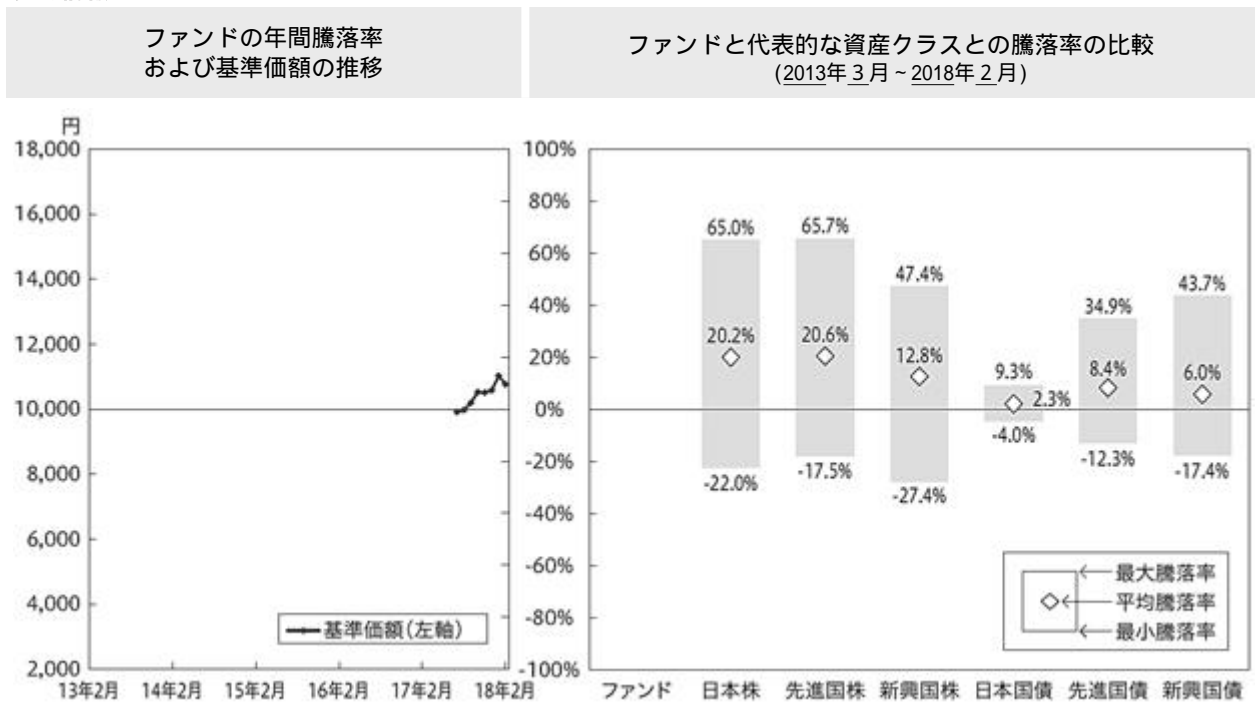
<訂正後>

(2)リスクの管理体制

<中略>

リスクの管理体制は、平成30年3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>



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ものです。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。

(注) 2018年2月末日現在において運用期間が1年に満たないため、左右グラフのファンドの騰落率は表示しておりません。

2013年3月～2018年2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。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。

<各資産クラスの指数>

<中略>

先進国債 FTSE世界国債指数(除く日本、円換算)

<中略>

上記各指数について

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)：東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とし、浮動株ベースの時価総額加重型で算出された指数で、同指数に関する知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）に帰属します。東証は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東証は同指数の算出もしくは公表方法の変更、同指数の算出もしくは公表の停止または同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。MSCIコクサイ指数(税引前配当込み)：MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、同指数に対する著作権およびその他の知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。MSCIエマージング・マーケット指数(税引前配当込み)：MSCIエマージング・マーケット指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、同指数に対する著作権およびその他の知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。NOMURA-BPI国債：NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。同指数の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また同社は同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果に関して一切責任を負いません。FTSE世界国債指数(除く日本)：FTSE世界国債指数(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券指数です。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド：JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、J.P.Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的な指数です。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。同指数の著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

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29年5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。

< 訂正後 >

上記は、平成30年3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30年2月28日現在です。

・投資比率はファンドまたはマザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	6,906,010,452	96.52
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		248,950,181	3.48
合計(純資産総額)		7,154,960,633	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		6,699,987,089	93.64

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考)ピクテ・セキュリティ・マザーファンド

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

株式	アメリカ	30,765,190,474	65.93
	イギリス	2,476,769,093	5.31
	オランダ	2,152,929,556	4.61
	日本	1,970,625,000	4.22
	アイルランド	1,589,297,182	3.41
	ドイツ	1,340,749,512	2.87
	スウェーデン	1,105,979,776	2.37
	フランス	1,098,805,555	2.35
	ジャージー	891,011,784	1.91
	スイス	758,978,391	1.63
	イスラエル	634,592,132	1.36
	ルクセンブルグ	447,717,312	0.96
	小計	45,232,645,767	96.94
投資証券	アメリカ	1,298,847,568	2.78
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		128,948,767	0.28
合計(純資産総額)		46,660,442,102	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	親投資信託受益証券	ピクテ・セキュリティ・マザーファンド	5,091,050,831	1.3427	6,835,866,226	1.3565	6,906,010,452	96.52

b 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.52
合計	96.52

(参考)ピクテ・セキュリティ・マザーファンド

a 評価額上位銘柄明細

順位	国・地域	種類	銘柄名	業種	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	アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	86,000	22,613.19	1,944,734,831	22,620.71	1,945,381,198	4.17
2	アメリカ	株式	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	ソフトウェア・ サービス	184,000	10,502.93	1,932,539,745	10,569.50	1,944,788,515	4.17
3	アメリカ	株式	3M CO	資本財	72,000	25,411.25	1,829,610,569	25,852.54	1,861,383,499	3.99
4	アメリカ	株式	FISERV INC	ソフトウェア・ サービス	103,000	15,323.84	1,578,356,179	15,483.82	1,594,834,253	3.42
5	アメリカ	株式	STANLEY BLACK & DECKER INC	資本財	88,500	17,154.50	1,518,173,683	17,356.36	1,536,037,904	3.29
6	アメリカ	株式	GLOBAL PAYMENTS INC	ソフトウェア・ サービス	117,000	12,277.75	1,436,497,862	12,261.65	1,434,613,518	3.07
7	アメリカ	株式	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	ソフトウェア・ サービス	148,000	9,349.77	1,383,767,380	9,447.48	1,398,227,972	3.00
8	アメリカ	株式	AUTOLIV INC	自動車・ 自動車部品	82,000	15,673.23	1,285,205,513	15,722.18	1,289,219,506	2.76

9	アメリカ	株式	PALO ALTO NETWORKS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	68,000	17,468.16	1,187,835,000	18,600.77	1,264,852,959	2.71
10	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC		25,861	43,302.32	1,119,841,323	42,004.21	1,086,271,074	2.33
11	アメリカ	株式	FORTINET INC	ソフトウェア・サービス	192,000	5,255.76	1,009,106,208	5,363.13	1,029,721,248	2.21
12	アイルランド	株式	ALLEGION PLC	資本財	102,000	8,931.25	910,987,780	9,337.96	952,472,828	2.04
13	アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフトウェア・サービス	54,000	16,611.76	897,035,327	17,537.81	947,042,053	2.03
14	アメリカ	株式	WORLDPAY INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	110,000	8,250.31	907,534,188	8,375.93	921,352,707	1.97
15	イギリス	株式	INTERTEK GROUP PLC	商業・専門サービス	125,000	7,321.20	915,150,375	7,351.05	918,881,875	1.97
16	アメリカ	株式	CINTAS CORP	商業・専門サービス	48,000	17,946.77	861,445,216	18,360.27	881,292,960	1.89
17	アメリカ	株式	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	56,000	12,915.67	723,277,750	15,071.52	844,005,506	1.81
18	日本	株式	トレンドマイクロ	情報・通信業	134,000	6,010.00	805,340,000	6,080.00	814,720,000	1.75
19	アメリカ	株式	WABCO HOLDINGS INC	資本財	51,000	14,818.13	755,724,819	15,099.44	770,071,598	1.65
20	オランダ	株式	INTERXION HOLDING NV	ソフトウェア・サービス	125,000	6,230.68	778,835,138	6,119.01	764,877,038	1.64
21	スイス	株式	SGS SA-REG	商業・専門サービス	2,700	269,542.98	727,766,046	279,259.33	754,000,191	1.62
22	アメリカ	株式	PERKINELMER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	90,000	8,201.99	738,179,487	8,262.12	743,590,935	1.59
23	オランダ	株式	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	資本財	127,000	5,782.94	734,434,421	5,765.76	732,252,663	1.57
24	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	55,000	13,083.03	719,566,898	13,246.23	728,543,030	1.56
25	スウェーデン	株式	ASSA ABLOY AB-B	資本財	300,000	2,304.16	691,250,400	2,415.66	724,698,000	1.55
26	アメリカ	株式	TRANSUNION	商業・専門サービス	115,500	6,275.77	724,852,186	6,157.66	711,210,827	1.52
27	アメリカ	株式	ECOLAB INC	素材	50,000	14,118.08	705,904,065	14,075.13	703,756,665	1.51
28	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	81,000	8,414.58	681,581,539	8,531.62	691,061,236	1.48
29	アメリカ	株式	PROOFPOINT INC	ソフトウェア・サービス	59,000	11,321.10	667,945,325	11,592.73	683,971,595	1.47
30	ドイツ	株式	CONTINENTAL AG	自動車・自動車部品	23,000	30,115.63	692,659,536	29,708.66	683,299,272	1.46

b 種類別および業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
----	-------	----	---------

株式	国内	輸送用機器	1.44
		精密機器	0.60
		情報・通信業	1.75
		サービス業	0.43
	国外	素材	1.51
		資本財	16.76
		商業・専門サービス	15.08
		自動車・自動車部品	5.18
		消費者サービス	1.01
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.67
		保険	0.65
		ソフトウェア・サービス	33.53
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.99
		半導体・半導体製造装置	2.34
投資証券		2.78	
合計		99.72	

【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】

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	51,524,201.91	5,497,348,707	5,526,485,890	77.24
	ユーロ	売建	3,387,847.32	449,120,580	444,756,593	6.22
	イギリスポンド	売建	3,055,685.81	456,432,658	455,908,318	6.37
	スイスフラン	売建	969,234.45	111,435,342	110,802,879	1.55
	スウェーデンクローネ	売建	12,425,875.17	165,862,977	162,033,409	2.26

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

平成30年2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
第1期末(平成30年2月20日)	7,019	7,019	10,688	10,688
平成29年7月末日	1,015		9,909	
8月末日	2,382		9,970	
9月末日	3,369		10,193	
10月末日	4,483		10,523	
11月末日	5,533		10,510	
12月末日	6,385		10,576	
平成30年1月末日	7,077		11,024	
2月末日	7,154		10,762	

(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)
第1期	平成29年7月24日～平成30年2月20日	0円

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	平成29年7月24日～平成30年2月20日	6.88

(注)収益率の計算方法：(計算期間末の基準価額(分配付き) - 設定日の基準価額) ÷ 設定日の基準価額 × 100

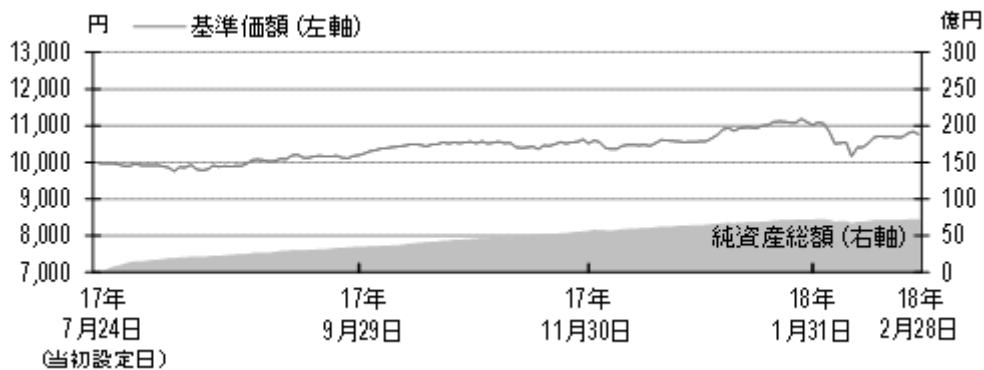
(4) 【設定及び解約の実績】

期	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	6,801,136,455	233,515,492

(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> (2018年2月28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(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
第1期 18年2月	0円
設定来 累計	0円

主要な資産の状況

ファンドの主要投資対象であるピクテ・セキュリティ・マザーファンドの状況です。

[組入上位10銘柄]

	銘柄名	国名	業種名	構成比
1	サーモフィッシャーサイエンティフィック	米国	ライフサイエンス関連	4.2%
2	フィデリティ・ナショナル・インフォメーション・サービス	米国	情報技術サービス	4.2%
3	3M	米国	コングロマリット	4.0%
4	フィサーブ	米国	情報技術サービス	3.4%
5	スタンレー・ブラック・アンド・デッカー	米国	機械	3.3%
6	グローバル・ペイメンツ	米国	情報技術サービス	3.1%
7	トータル・システム・サービス	米国	情報技術サービス	3.0%
8	オートリブ	スウェーデン	自動車部品	2.8%
9	パロアルトネットワークス	米国	通信機器	2.7%
10	エクイニクス	米国	エクイティ不動産投資信託(REIT)	2.3%

[国別構成比]

	国名	構成比
1	米国	71.5%
2	英国	6.6%
3	スウェーデン	5.1%
4	日本	4.2%
5	フランス	3.3%
	その他の国	8.9%
	コールローン等、その他	0.3%

合計	100%
----	------

構成比は、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価金額の割合です。

年間収益率の推移



2017年は当初設定時(2017年7月24日)以降、2018年は2月28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) ファンドの財務諸表は、「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)並びに同規則第2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、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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款第39条により、平成29年7月24日(設定日)から平成30年2月20日までとしております。

(3) 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期計算期間(平成29年7月24日(設定日)から平成30年2月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

ピクテ・セキュリティ・ファンド(為替ヘッジあり)

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

第1期
[平成30年2月20日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	30,113,757
親投資信託受益証券	6,748,167,905
派生商品評価勘定	244,170,927
未収入金	12,859,378
流動資産合計	7,035,311,967
資産合計	7,035,311,967
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,030,865
未払金	5,334,516
未払受託者報酬	161,028
未払委託者報酬	9,201,658
未払利息	82
その他未払費用	287,543
流動負債合計	16,015,692
負債合計	16,015,692
純資産の部	
元本等	
元本	6,567,620,963
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	451,675,312
(分配準備積立金)	267,654,193
元本等合計	7,019,296,275
純資産合計	7,019,296,275
負債純資産合計	7,035,311,967

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第1期
自 平成29年7月24日
至 平成30年2月20日

営業収益	
有価証券売買等損益	148,294,265
為替差損益	176,719,519
営業収益合計	325,013,784
営業費用	
支払利息	33,132
受託者報酬	783,767
委託者報酬	44,786,569
その他費用	1,400,549
営業費用合計	47,004,017
営業利益又は営業損失()	278,009,767
経常利益又は経常損失()	278,009,767
当期純利益又は当期純損失()	278,009,767
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()	10,355,574
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	188,007,014
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	188,007,014
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,985,895
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,985,895
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	451,675,312

(3)【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	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。
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取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)

	第1期 平成30年2月20日現在
1. 元本の推移	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	6,800,136,455円
期中一部解約元本額	233,515,492円
2. 受益権の総数	6,567,620,963口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年7月24日 至 平成30年2月20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0.60%以内の額	
2. 分配金の計算過程	
費用控除後の配当等収益額	A 17,705,770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 249,948,423円
収益調整金額	C 184,021,119円
分配準備積立金額	D 0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 451,675,312円
当ファンドの期末残存口数	F 6,567,620,963口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000 687.70円
10,000口当たり分配金額	H 0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 平成29年7月24日 至 平成30年2月20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。
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、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。

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> <ul style="list-style-type: none"> ・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。
-------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

金融商品の時価等に関する事項

	<p style="text-align: center;">第1期 自 平成29年7月24日 至 平成30年2月20日</p>
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。
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>
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る場合、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>
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年以内に償還されます。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(平成30年2月20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
親投資信託受益証券	142,807,078
合計	142,807,078

(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

第1期(平成30年2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)

市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	売建	6,552,461,478	-	6,309,321,416	243,140,062
	米ドル	5,356,711,455	-	5,120,274,337	236,437,118
	ユーロ	478,676,400	-	476,535,221	2,141,179
	イギリスポンド	439,439,052	-	435,038,856	4,400,196
	スイスフラン	111,683,842	-	112,631,480	947,638
	スウェーデンクローネ	165,950,729	-	164,841,522	1,109,207
	合計	6,552,461,478	-	6,309,321,416	243,140,062

(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)

	第1期 (平成30年2月20日現在)
1口当たり純資産額	1.0688円
(1万口当たり純資産額)	(10,688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・セキュリティ・マザーファンド	5,026,568,272	6,748,167,905	
合計		5,026,568,272	6,748,167,905	

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。

(参考)

ファンドは、「ピクテ・セキュリティ・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。

ピクテ・セキュリティ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[平成30年2月20日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	59,116
コール・ローン	28,036,855
株式	44,534,472,618
投資証券	1,546,861,296
未収入金	179,234,838
未収配当金	38,425,944
流動資産合計	46,327,090,667
資産合計	46,327,090,667
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	528,000
未払解約金	104,700,000
未払利息	76
流動負債合計	105,228,076
負債合計	105,228,076
純資産の部	
元本等	
元本	34,428,447,529
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,793,415,062
元本等合計	46,221,862,591
純資産合計	46,221,862,591
負債純資産合計	46,327,090,667

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	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについてはそれに準ずる価額)、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
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30年2月20日現在
1. 元本の推移	
期首相当日現在元本額	27,835,655,910円
期中追加設定元本額	11,529,543,399円
期中一部解約元本額	4,936,751,780円
期末元本額	34,428,447,529円
元本の内訳	
ピクテ・セキュリティ・ファンド(為替ヘッジなし)	27,242,362,881円
ピクテ・セキュリティ・ファンド(為替ヘッジあり)	5,026,568,272円
ピクテ・セキュリティ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,159,516,376円
2. 受益権の総数	34,428,447,529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29年7月24日 至 平成30年2月20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。
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、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。
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。

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成29年7月24日 至 平成30年2月20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。
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 「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。 (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。 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。
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年以内に償還されます。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成30年2月20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
株式	4,473,030,726
投資証券	95,839,650
合計	4,377,191,076

(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30年2月20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	84,904,000	-	85,432,000	528,000
	米ドル	84,904,000	-	85,432,000	528,000
合計		84,904,000	-	85,432,000	528,000

(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30年2月20日現在)	
1口当たり純資産額	1.3425円

(1万口当たり純資産額)

(13,425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

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
円	デンソー	121,000	6,231.00	753,951,000	
	島津製作所	116,000	2,670.00	309,720,000	
	トレンドマイクロ	139,000	6,010.00	835,390,000	
	総合警備保障	51,000	5,230.00	266,730,000	
	円 小計	427,000		2,165,791,000	
米ドル	ECOLAB INC	50,000	131.49	6,574,500.00	
	3M CO	72,000	236.67	17,040,240.00	
	ALLEGION PLC	91,000	82.72	7,527,520.00	
	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	89,000	63.82	5,679,980.00	
	GENERAC HOLDINGS INC	500	45.69	22,845.00	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	156,000	38.42	5,993,520.00	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	127,000	53.86	6,840,220.00	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	88,500	159.77	14,139,645.00	
	WABCO HOLDINGS INC	51,000	138.01	7,038,510.00	
	BRINK'S CO/THE	40,000	75.65	3,026,000.00	
	CINTAS CORP	46,000	167.12	7,687,520.00	
	EQUIFAX INC	27,000	117.46	3,171,420.00	
	MSA SAFETY INC	70,000	77.60	5,432,000.00	
	ROLLINS INC	118,000	49.89	5,887,020.00	
	TRANSUNION	115,500	58.45	6,750,975.00	
	AUTOLIV INC	69,000	145.81	10,060,890.00	
	SERVICEMASTER GLOBAL HOLDING	69,000	54.74	3,777,060.00	
	BRUKER CORP	90,000	32.10	2,889,000.00	
	PERKINELMER INC	90,000	76.39	6,875,100.00	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	89,000	210.61	18,744,290.00	
	WATERS CORP	26,000	206.18	5,360,680.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,000	109.43	2,845,180.00	
	CA INC	20,000	35.34	706,800.00	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	59,000	103.28	6,093,520.00	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	187,000	97.82	18,292,340.00	
	FISERV INC	103,000	142.72	14,700,160.00	
	FORTINET INC	192,000	48.95	9,398,400.00	
	GLOBAL PAYMENTS INC	117,000	114.35	13,378,950.00	
	INTERXION HOLDING NV	133,000	58.03	7,717,990.00	
	MIMECAST LTD	76,000	33.23	2,525,480.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	81,000	78.37	6,347,970.00		
PROOFPOINT INC	47,000	105.25	4,946,750.00		
QUALYS INC	60,000	72.25	4,335,000.00		

	SERVICENOW INC	47,000	154.03	7,239,410.00	
	SPLUNK INC	44,000	92.64	4,076,160.00	
	SYMANTEC CORP	205,000	27.55	5,647,750.00	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	148,000	87.08	12,887,840.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	55,000	121.85	6,701,750.00	
	WORLDPAY INC-CLASS A	118,000	76.84	9,067,120.00	
	LITTELFUSE INC	26,000	208.05	5,409,300.00	
	NCR CORPORATION	15,000	32.63	489,450.00	
	PALO ALTO NETWORKS INC	65,000	162.08	10,535,200.00	
	VERIFONE SYSTEMS INC	1,000	17.37	17,370.00	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	52,000	120.25	6,253,000.00	
	KLA-TENCOR CORPORATION	34,000	107.52	3,655,680.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	54,000	118.50	6,399,000.00	
	米ドル 小計	3,539,500		320,186,505.00 (34,195,918,734)	
ユーロ	CONTINENTAL AG	29,000	229.40	6,652,600.00	
	VALEO SA	73,000	59.84	4,368,320.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC	7,250	484.40	3,511,900.00	
	WIRECARD AG	41,500	97.78	4,057,870.00	
	WORLDLINE SA	13,000	42.50	552,500.00	
	INGENICO GROUP	66,000	90.74	5,988,840.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,000	22.02	88,080.00	
	ユーロ 小計	233,750		25,220,110.00 (3,342,673,379)	
イギリスポンド	EXPERIAN PLC	260,000	15.39	4,002,700.00	
	G4S PLC	630,000	2.58	1,625,400.00	
	INTERTEK GROUP PLC	125,000	49.05	6,131,250.00	
	RENTOKIL INITIAL PLC	1,310,000	2.87	3,763,630.00	
	SOPHOS GROUP PLC	365,000	5.00	1,825,000.00	
	HALMA PLC	230,000	12.01	2,762,300.00	
	イギリスポンド 小計	2,920,000		20,110,280.00 (3,005,481,346)	
スイスフラン	DORMAKABA HOLDING AG	100	850.50	85,050.00	
	SGS SA-REG	2,700	2,358.00	6,366,600.00	
	スイスフラン 小計	2,800		6,451,650.00 (741,617,167)	
スウェーデンクローネ	ASSA ABLOY AB-B	300,000	176.70	53,010,000.00	
	LOOMIS AB-B	53,000	290.00	15,370,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	92,000	137.85	12,682,200.00	
	スウェーデンクローネ 小計	445,000		81,062,200.00 (1,082,990,992)	
	合計	7,568,050		44,534,472,618 (42,368,681,618)	

(注)

1. 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。
2. 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。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額(口)	評価額	備考
投資証券	米ドル	DIGITAL REALTY TRUST INC	12,000	1,226,400.00	
		EQUINIX INC	29,500	11,897,350.00	
		IRON MOUNTAIN INC	41,000	1,359,970.00	
	米ドル 小計		82,500	14,483,720.00 (1,546,861,296)	
合計			82,500	1,546,861,296 (1,546,861,296)	

(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	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計額に対する比率
米ドル	株式 46銘柄	95.7%		81.4%
	投資証券 3銘柄		4.3%	
ユーロ	株式 7銘柄	100.0%		7.6%
イギリスポンド	株式 6銘柄	100.0%		6.8%
スイスフラン	株式 2銘柄	100.0%		1.7%
スウェーデンクローネ	株式 3銘柄	100.0%		2.5%

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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成30年2月28日現在です。

【純資産額計算書】

資産総額	7,170,124,996円
負債総額	15,164,363円
純資産総額(-)	7,154,960,633円
発行済口数	6,648,652,741口
1万口当たり純資産額(/)	10,762円

(参考)ピクテ・セキュリティ・マザーファンド

資産総額	46,984,105,594円
負債総額	323,663,492円
純資産総額(-)	46,660,442,102円
発行済口数	34,396,810,793口
1万口当たり純資産額(/)	13,565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29年5月末日現在：2億円

< 訂正後 >

(1) 資本金の額

平成30年3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29年5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)
追加型株式投資信託	90	1,357,517,274,624
単位型株式投資信託	9	46,430,768,072
合計	99	1,403,948,042,696

< 訂正後 >

平成30年3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)
追加型株式投資信託	98	1,412,685,591,146
単位型株式投資信託	14	61,516,877,351
合計	112	1,474,202,468,497

< 後略 >

3【委託会社等の経理状況】

< 以下の内容に更新します。 >

(1) 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。

なお、財務諸表の金額については、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33期(平成29年1月1日から平成29年12月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人の監査を受けております。

財務諸表

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成28年12月31日現在)	第33期 (平成29年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	924,365	1,525,089
前払費用	59,747	60,122
未収委託者報酬	1,153,310	1,532,316
未収還付法人税等	345,831	-
未収入金	55,343	-
未収収益	139,176	696,208
繰延税金資産	162,143	339,084
その他	2,431	8,072
流動資産計	2,842,350	4,160,893
固定資産		
有形固定資産		
建物付属設備	1 231,871	210,479
器具備品	1 143,817	133,271
有形固定資産合計	375,688	343,751
無形固定資産		
ソフトウェア	27,488	61,790
その他	831	831
無形固定資産合計	28,320	62,622
投資その他の資産		
投資有価証券	8,765	4,119
長期差入保証金	284,854	284,554
繰延税金資産	521,213	512,781
投資その他の資産合計	814,832	801,454
固定資産計	1,218,842	1,207,828
資産合計	4,061,192	5,368,721

(単位：千円)

	第32期 (平成28年12月31日現在)	第33期 (平成29年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	57,245	29,125
未払金		
未払手数料	689,715	861,397
その他未払金	344,363	297,619
未払法人税等	-	387,407
賞与引当金	459,502	937,113
その他	-	50,083
流動負債合計	1,550,826	2,562,746
固定負債		
退職給付引当金	392,032	302,281
資産除去債務	81,151	81,345
固定負債合計	473,184	383,627
負債合計	2,024,011	2,946,374
純資産の部		
株主資本		
資本金	200,000	200,000
利益剰余金		
利益準備金	50,000	50,000
その他利益剰余金	1,786,067	2,171,640
繰越利益剰余金	1,786,067	2,171,640
利益剰余金合計	1,836,067	2,221,640
株主資本合計	2,036,067	2,421,640
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,114	707
評価・換算差額等合計	1,114	707
純資産合計	2,037,181	2,422,347
負債・純資産合計	4,061,192	5,368,721

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)	第33期 (自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	15,368,625	14,705,428
その他営業収益	507,886	1,217,445
営業収益計	15,876,511	15,922,874
営業費用		

支払手数料		9,881,105	9,345,108
広告宣伝費		283,435	313,373
調査費			
調査費		131,020	145,561
委託調査費		688,993	906,242
委託計算費		370,168	368,263
営業雑経費			
通信費		35,828	48,335
印刷費		305,457	275,003
諸会費		13,241	11,174
図書費		3,063	2,693
諸経費		3,973	3,383
営業費用計		11,716,287	11,419,141
一般管理費			
給料			
役員報酬		96,100	128,559
給料・手当		1,713,891	1,736,346
賞与	1	313,895	253,627
賞与引当金繰入		459,502	882,289
旅費交通費		132,406	132,367
租税公課		28,797	58,084
不動産賃借料		298,001	326,527
退職給付費用	2	204,549	94,619
固定資産減価償却費		69,221	75,270
消耗器具備品費		18,116	20,504
人材採用費		62,443	22,258
修繕維持費		38,352	34,385
諸経費		176,363	165,017
一般管理費計		3,611,641	3,929,857
営業利益		548,583	573,875
営業外収益			
受取利息		49	49
投資有価証券売却益		2,783	1,521
法人税等還付加算金		-	4,048
その他		2,396	2,240
営業外収益計		5,228	7,860
営業外費用			
その他	3	33,337	1,062
営業外費用計		33,337	1,062
経常利益		520,474	580,672
税引前当期純利益		520,474	580,672
法人税、住民税及び事業税		24,985	363,369
法人税等還付税額		39,673	-
法人税等調整額		83,249	168,270
法人税等合計額		68,561	195,099

当期純利益

451,913

385,573

(3)【株主資本等変動計算書】

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

(千円)

	株主資本					評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	利益剰余金			株主資本 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	利益 剰余金 合計				
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
当期変動額								
剰余金の配当	-	-	500,000	500,000	500,000	-	-	500,000
当期純利益	-	-	451,913	451,913	451,913	-	-	451,913
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	1,798	1,798	1,798
当期変動額合計	-	-	48,086	48,086	48,086	1,798	1,798	49,884
当期末残高	200,000	50,000	1,786,067	1,836,067	2,036,067	1,114	1,114	2,037,181

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

(千円)

	株主資本					評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	利益剰余金			株主資本 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	利益 剰余金 合計				
当期首残高	200,000	50,000	1,786,067	1,836,067	2,036,067	1,114	1,114	2,037,181
当期変動額								
当期純利益	-	-	385,573	385,573	385,573	-	-	385,573
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	407	407	407
当期変動額合計	-	-	385,573	385,573	385,573	407	407	385,165
当期末残高	200,000	50,000	2,171,640	2,221,640	2,421,640	707	707	2,422,347

重要な会計方針

区分	
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	(1) 其他有価証券 時価のあるもの 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、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	(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。 (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、支出見込額の当期負担分を計上しております。 (3)退職給付引当金 従業員及び役員の退職金に充てるため、当期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期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。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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。

注記事項

(貸借対照表関係)

第32期 平成28年12月31日現在	第33期 (平成29年12月31日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物付属設備 253,020千円	建物付属設備 275,494千円
器具備品 272,249千円	器具備品 306,543千円

(損益計算書関係)

第32期 自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日	第33期 自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日
1 従業員及び役員の賞与であります。	1 従業員及び役員の賞与であります。
2 従業員及び役員の退職給付費用であります。	2 従業員及び役員の退職給付費用であります。
3 主な内訳は次のとおりであります。 過失により生じた損害の賠償 32,818千円	3 主な内訳は次のとおりであります

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	第32期首 株式数 (株)	第32期 増加株式数 (株)	第32期 減少株式数 (株)	第32期末 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

決議	株式の種類	配当の総額 (千円)	配当の原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年12月7日 臨時株主総会	普通株式	500,000	利益剰余金	625,000	平成27年12月31日	平成28年12月8日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	第33期首 株式数 (株)	第33期 増加株式数 (株)	第33期 減少株式数 (株)	第33期末 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) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. ファイナンス・リース取引(借主側)

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

	(千円)
1年内	272,255
1年超	668,112
合計	940,367

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. ファイナンス・リース取引(借主側)

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

	(千円)
1年内	285,676
1年超	569,660
合計	855,336

(金融商品に関する注記)

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

余剰資金については銀行預金(普通預金、定期預金又は信託預金)で運用しております。

(2) 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク

銀行預金は、本邦銀行に預け入れているものと海外にある当社のグループ銀行に預け入れているものがあります。本邦銀行に預け入れているものは、その元本が預金保険制度の対象となっております。グループ銀行に預け入れている預金は、グループ銀行の破たんによる信用リスクに晒されております。

営業債権である未収委託者報酬は、信託銀行により分別保管されている投資信託の信託財産から直接支弁されるので信用リスクは発生せず、また投資信託の決算日までに信託財産が減少し委託者報酬が支払えなくなるというマーケットリスクは非常に低いものと考えております。

営業債務である未払手数料は、回収不能となるリスクの非常に低い委託者報酬の入金後、これを原資に支払いをおこなうので、支払不能となる流動性リスクは非常に低いものと考えております。また、その他未払金については、その債務を履行するに十分な即時引出し可能な決済性預金を保有していることから、流動性不足はないものと考えております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は本邦銀行における預金を預金保険制度の保険対象範囲に限定して信用リスクの軽減を図っており、その状況は代表取締役およびビクテグループファイナンスに報告されモニタリングされています。

2. 金融商品の時価等に関する事項

(1) 平成28年12月31日における金融商品の貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額は次のとおりであります。

(千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	924,365	924,365	-
未収委託者報酬	1,153,310	1,153,310	-
未収還付法人税等	345,831	345,831	-
未払手数料	689,715	689,715	-
その他未払金	344,363	344,363	-

(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といった当社の金融商品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284,854千円)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。

(4) 金銭債権の償還予定額は次のとおりであります。

(千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	924,365	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,153,310	-	-	-	-	-
未収還付法人税等	345,831	-	-	-	-	-

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

余剰資金については銀行預金(普通預金、定期預金又は信託預金)で運用しております。

(2) 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク

銀行預金は、本邦銀行に預け入れているものと海外にある当社のグループ銀行に預け入れているものがあります。本邦銀行に預け入れているものは、その元本が預金保険制度の対象となっております。グループ銀行に預け入れている預金は、グループ銀行の破たんによる信用リスクに晒されております。

営業債権である未収委託者報酬は、信託銀行により分別保管されている投資信託の信託財産から直接支弁されるので信用リスクは発生せず、また投資信託の決算日までに信託財産が減少し委託者報酬が支払えなくなるというマーケットリスクは非常に低いものと考えております。

営業債務である未払手数料は、回収不能となるリスクの非常に低い委託者報酬の入金後、これを原資に支払いをおこなうので、支払不能となる流動性リスクは非常に低いものと考えております。また、その他未払金については、その債務を履行するに十分な即時引出し可能な決済性預金を保有していることから、流動性不足はないものと考えております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は本邦銀行における預金を預金保険制度の保険対象範囲に限定して信用リスクの軽減を図っており、その状況は代表取締役およびビクテグループファイナンスに報告されモニタリングされています。

2. 金融商品の時価等に関する事項

(1) 平成29年12月31日における金融商品の貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額は次のとおりであります。

(千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	1,525,089	1,525,089	-
未収委託者報酬	1,532,316	1,532,316	-
未払手数料	861,397	861,397	-
その他未払金	297,619	297,619	-

(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といった当社の金融商品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284,554千円)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。

(4) 金銭債権の償還予定額は次のとおりであります。

(千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	1,525,089	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,532,316	-	-	-	-	-

(有価証券関係)

第32期(平成28年12月31日現在)

1. その他有価証券で時価のあるもの

(千円)

区分	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
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	5,900	7,679	1,779
	小計	5,900	7,679	1,779
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	1,200	1,085	115
	小計	1,200	1,085	115
合計		7,100	8,765	1,665

2. 当期中に売却されたその他有価証券(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

(千円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託受益証券	9,039	2,783	376
合計	9,039	2,783	376

第33期(平成29年12月31日現在)

1. その他有価証券で時価のあるもの

(千円)

区分	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
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	1,800	2,868	1,068
	小計	1,800	2,868	1,068
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	1,300	1,250	49
	小計	1,300	1,250	49
合計		3,100	4,119	1,019

2. 当期中に売却されたその他有価証券(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

(千円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託受益証券	6,288	1,521	-
合計	6,288	1,521	-

(デリバティブ取引関係)

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

当社は、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

当社は、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員及び役員の退職給付に充てるため、積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。確定給付企業年金制度では、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

2. 退職給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,542,652
勤務費用	48,616
利息費用	9,209
数理計算上の差異の発生額	64,961
退職給付の支払額	44,427
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,621,013</u>

(2) 年金資産の期首残高と期末残高との調整表

	(千円)
年金資産の期首残高	1,157,782
期待運用収益	11,577
数理計算上の差異の発生額	9,851
事業主からの拠出額	49,769
<u>年金資産の期末残高</u>	<u>1,228,980</u>

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,621,013
年金資産	1,228,980
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>392,032</u>

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	48,616
利息費用	9,209
期待運用収益	11,577
数理計算上の差異の費用処理額	55,109
<u>退職給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>101,358</u>

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、以下のとおりであります。

証券投資信託受益証券	33.5%
投資証券	51.8%
株式	2.0%
その他	12.7%
<u>合計</u>	<u>100.0%</u>

(注)年金資産は全て企業年金制度に対して設定した退職給付信託であります。

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当期末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.30%

長期期待運用収益率 1.00%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は103,192千円であります。

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員及び役員の退職給付に充てるため、積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。
確定給付企業年金制度では、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

2. 退職給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,621,013
勤務費用	62,729
利息費用	4,850
数理計算上の差異の発生額	4,375
退職給付の支払額	76,576
退職給付債務の期末残高	1,607,639

(2) 年金資産の期首残高と期末残高との調整表

	(千円)
年金資産の期首残高	1,228,980
期待運用収益	12,289
数理計算上の差異の発生額	55,244
事業主からの拠出額	8,843
年金資産の期末残高	1,305,358

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,607,639
年金資産	1,305,358
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	302,281

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	62,729
利息費用	4,850
期待運用収益	12,289
数理計算上の差異の費用処理額	59,620
退職給付制度に係る退職給付費用	4,330

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、以下のとおりであります。

証券投資信託受益証券	32.3%
投資証券	34.5%
株式	2.0%
その他	31.0%
合計	100.0%

(注)年金資産は全て企業年金制度に対して設定した退職給付信託であります。

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当期末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.30%

長期期待運用収益率 1.00%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は98,950千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳

(千円)

区分	第32期 (平成28年12月31日現在)	第33期 (平成29年12月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金損金算入限度超過額	497,362	469,362
未払事業税否認	-	23,712
賞与引当金損金算入限度超過額	169,106	299,785
資産除去債務	17,965	18,951
その他	20,943	40,367
繰延税金資産小計	705,376	852,178
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	705,376	852,178
繰延税金負債		
未収還付事業税	21,468	-
その他有価証券評価差額	550	312
繰延税金負債小計	22,019	312
繰延税金資産合計(純額)	683,357	851,865

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第32期 (平成28年12月31日現在)		第33期 (平成29年12月31日現在)	
法定実効税率	33.0%	法定実効税率	30.8%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金算入されない項目	3.5%	交際費等永久に損金算入されない項目	2.4%
評価性引当金	23.3%	評価性引当金	-
法人税率の変更等による影響	8.5%	法人税率の変更等による影響	-
過年度法人税等	7.6%	過年度法人税等	-
その他	1.0%	その他	0.2%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	13.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.6%

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

第32期(平成28年12月31日現在)

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15条)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成29年1月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について前事業年度の32.26%から

30.86%に、平成31年1月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について30.62%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が44,564千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が同額増加しております。

第33期(平成29年12月31日現在)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

第32期(平成28年12月31日現在)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

- (1) 東京本社事務所用ビルの不動産賃借契約に伴う原状回復費用であります。
 (2) 大阪連絡事務所用ビルの不動産賃借契約に伴う原状回復費用であります。

2. 当該資産除去債務の金額と算定方法

(1) 東京本社事務所用ビル

使用見込期間を取得から10年と見積り、割引率は1.13%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。増床部分は使用見込期間を取得から10年と見積り、割引率は0.53%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

(2) 大阪連絡事務所用ビル

使用見込期間を取得から10年と見積り、割引率は0.96%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当期における当該資産除去債務の総額の増減

	(千円)
期首残高	80,912
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	239
資産除去債務の履行による減少額	-
期末残高	81,151

第33期(平成29年12月31日現在)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

- (1) 東京本社事務所用ビルの不動産賃借契約に伴う原状回復費用であります。
 (2) 大阪連絡事務所用ビルの不動産賃借契約に伴う原状回復費用であります。

2. 当該資産除去債務の金額と算定方法

(1) 東京本社事務所用ビル

使用見込期間を取得から10年と見積り、割引率は1.13%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。増床部分は使用見込期間を取得から10年と見積り、割引率は0.53%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

(2) 大阪連絡事務所用ビル

使用見込期間を取得から10年と見積り、割引率は0.96%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当期における当該資産除去債務の総額の増減

	(千円)
期首残高	81,151
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	193
資産除去債務の履行による減少額	-
期末残高	81,345

(セグメント情報等)

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. セグメント情報

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

(1) 製品及びサービスごとの情報

(千円)

	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	15,368,625	310,642	197,244	15,876,511

(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。

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. セグメント情報

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

(1) 製品及びサービスごとの情報

(千円)

	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	14,705,428	401,758	815,687	15,922,874

(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。

(関連当事者との取引関係)

第32期(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	ビクテ アンド シー グループ エスシーエー	スイス、 ジュネーブ	CHF148,500,000	グループ 管理会社	間接100%	グループ会社管理 に関するサービスの 提供	コーディネー ション手数料 の支払(注1)	69,058	未払金	-

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の 親会社を 持つ会社	ビクテ アセット マネージメント エスエー	スイス、 ジュネーブ	CHF21,000,000	資産運用 会社	-	投資運用の委託 契約 投資運用に関する サービスの提供	運用手数料 の支払(注2)	411,227	未払金	39,450
							運用手数料 の受取(注2)	5,252	未収 収益	1,657
							翻訳事務 手数料の受取 (注3)	9,636	未収 収益	2,850
同一の 親会社を 持つ会社	ビクテ アセット マネージメント リミテッド	英国、 ロンドン	GBP45,000,000	資産運用 会社	-	投資運用の委託 契約 投資運用に関する サービスの提供	運用手数料 の支払(注2)	234,350	未払金	42,288
							翻訳事務 手数料の受取 (注3)	1,448	未収 収益	-
同一の 親会社を 持つ会社	ビクテ アセット マネージメント (ヨーロッパ) エスエー	ルクセン ブルグ	CHF8,750,000	資産運用 会社	-	投資運用の委託 契約 投資運用に関する サービスの提供 役員の兼任	運用手数料 の支払(注2)	43,415	未払金	18,532
							運用手数料 の受取(注2)	4,003	未収 収益	2,041
							翻訳事務 手数料の受取 (注3)	54,217	未収 収益	-
同一の 親会社を 持つ会社	ビクテ アセット マネージメント (ホンコン) リミテッド	香港	HKD30,000,000	資産運用 会社	-	投資運用に関する サービスの提供	トレーディ ング手数料 の支払(注4)	23,566	未払金	15,793

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) コーディネーション手数料については、関連会社間の契約に基づき、決定しております。

(注2) 運用手数料についてはファンド毎の契約運用資産に一定比率を乗じて決定しております。

(注3) 翻訳事務手数料については、関連会社間の契約に基づき、決定しております。

(注4) トレーディング手数料については、関連会社間の契約に基づき、決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ビクテ アンド シー グループ エスシーエー(非上場)

ピクテ アセット マネージメント エスエー(非上場)

ピクテ アジア プライベート リミテッド(非上場)

(2)重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

第33期(自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	ピクテ アンド シー グループ エスシーエー	スイス, ジュネーブ	CHF148,500,000	グループ 管理会社	間接100%	グループ会社管理 に関するサービスの 提供	コーディネー ション手数料 の支払(注1)	52,799	未払金	-

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	ピクテ アセット マネージメント エスエー	スイス、 ジュネーブ	CHF21,000,000	資産運用 会社	-	投資運用の委託 契約 投資運用に関する サービスの提供	運用手数料 の支払(注2)	644,985	未払金	69,905
							運用手数料 の受取(注2)	483,873	未収 収益	416,082
							翻訳事務 手数料の受取 (注3)	12,234	未収 収益	-
同一の親会社を持つ会社	ピクテ アセット マネージメント リミテッド	英国、 ロンドン	GBP45,000,000	資産運用 会社	-	投資運用の委託 契約 投資運用に関する サービスの提供	運用手数料 の支払(注2)	214,132	未払金	49,143
							翻訳事務 手数料の受取 (注3)	1,448	未収 収益	-
同一の親会社を持つ会社	ピクテ アセット マネ - ジメント (ヨーロッパ) エスエー	ルクセン ブルグ	CHF8,750,000	資産運用 会社	-	投資運用の委託 契約 投資運用に関する サービスの提供 役員の兼任	運用手数料 の支払(注2)	47,124	未払金	20,625
							運用手数料 の受取(注2)	126,975	未収 収益	20,087
							翻訳事務 手数料の受取 (注3)	54,217	未収 収益	-
同一の親会社を持つ会社	ピクテ アセット マネージメント (ホンコン) リミテッド	香港	HKD30,000,000	資産運用 会社	-	投資運用に関する サービスの提供	トレーディング 手数料の支払 (注4)	68,941	未払金	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)コーディネーション手数料については、関連会社間の契約に基づき、決定しております。

(注2)運用手数料についてはファンド毎の契約運用資産に一定比率を乗じて決定しております。

(注3)翻訳事務手数料については、関連会社間の契約に基づき、決定しております。

(注4)トレーディング手数料については、関連会社間の契約に基づき、決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ピクテ アンド シー グループ エスシーエー(非上場)

ピクテ アセット マネージメント エスエー(非上場)

ピクテ アジア プライベート リミテッド(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

(1 株当たり情報)

第32期 自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日		第33期 自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日	
1株当たり純資産額	2,546,477円36銭	1株当たり純資産額	3,027,934円85銭
1株当たり当期純利益	564,891円70銭	1株当たり当期純利益	481,966円86銭
損益計算書上当期純利益	451,913千円	損益計算書上当期純利益	385,573千円
1株当たり当期純利益の算定に用いられた当期純利益	451,913千円	1株当たり当期純利益の算定に用いられた当期純利益	385,573千円
差額	-	差額	-
期中平均株式数		期中平均株式数	
普通株式	800株	普通株式	800株
なお、潜在株式調整後1株当たり当期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。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期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】

< 前略 >

< 訂正前 >

(2)販売会社

名称	資本金の額	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社(注1)	10,000百万円	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。
S M B C フレンド証券株式会社(注1)	27,270百万円	
野村証券株式会社(注1)	10,000百万円	
三井住友信託銀行株式会社(注2)	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

平成29年3月末日現在

(注1) S M B C 日興証券株式会社、S M B C フレンド証券株式会社および野村証券株式会社は、平成29年7月24日から取扱いを行います。

(注2) 三井住友信託銀行株式会社は、当初申込日においては委託会社による買付にかかる取得申込みのみを取扱い、継続申込期間は募集・販売業務を取扱いません。

(3)投資顧問会社

名称	資本金の額	事業の内容
ビクテ・アセット・マネジメント・エス・エイ	2,100万スイスフラン (約2,387百万円)	スイス籍の法人であり、内外の有価証券等に係る投資顧問業務およびその業務に付随する一切の業務を営んでいます。

平成29年5月末日現在。スイスフランの円貨換算は、平成29年5月末日現在の株式会社三菱東京U F J 銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=113.67円)によります。

< 訂正後 >

(2)販売会社

名称	資本金の額	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社 野村証券株式会社 岡三証券株式会社 三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社 第四証券株式会社	10,000百万円 10,000百万円 5,000百万円 40,500百万円 600百万円	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。
三井住友信託銀行株式会社(注)	342,037百万円	

平成29年3月末日現在

(注) 三井住友信託銀行株式会社は、当初申込日においては委託会社による買付にかかる取得申込みのみを取扱い、継続申込期間は募集・販売業務を取扱いません。

(3)投資顧問会社

名称	資本金の額	事業の内容
ビクテ・アセット・マネジメント・エス・エイ	2,100万スイスフラン (約2,337百万円)	スイス籍の法人であり、内外の有価証券等に係る投資顧問業務およびその業務に付随する一切の業務を営んでいます。

平成30年3月末日現在。スイスフランの円貨換算は、平成30年3月30日現在の株式会社三菱U F J 銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=111.33円)によります。

独立監査人の監査報告書

平成30年3月7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、「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29年1月1日から平成29年12月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、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監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、独立の立場から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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ピクテ投信投資顧問株式会社の平成29年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に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

上記は、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。

独立監査人の監査報告書

平成30年4月4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・セキュリティ・ファンド(為替ヘッジあり)の平成29年7月24日から平成30年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、独立の立場から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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ピクテ・セキュリティ・ファンド(為替ヘッジあり)の平成30年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に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、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。