

【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】	2019年8月20日
【発行者名】	楽天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 東 眞之
【本店の所在の場所】	東京都世田谷区玉川一丁目14番1号
【事務連絡者氏名】	石舘 真 連絡場所：東京都世田谷区玉川一丁目14番1号
【電話番号】	03 - 6432 - 7746
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	楽天グローバル・プレミア・ファンド（ロボット自動運用型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	2,000億円を上限とします。
【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、半期報告書を提出いたしましたので、2019年2月20日付で提出した有価証券届出書（以下、「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項のうち訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

【訂正の内容】

原届出書において、以下に記載した箇所を、＜訂正前＞の内容から＜訂正後＞の内容に訂正し、また、更新します。

____部分は、訂正部分を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」、「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

また、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」の「1 財務諸表」については末尾に「中間財務諸表」を追加し、「2 ファンドの現況」については原届出書の更新後の内容を記載します。

第一部【証券情報】

（５）【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料は、申込金額（取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た金額）に、3.24%（税込）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た金額となります。当該手数料には消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が含まれません。

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。
手数料について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（後略）

<訂正後>

申込手数料は、申込金額（取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た金額）に、3.24%（税込）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た金額となります。当該手数料には消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が含まれません。

消費税率が10%となった場合は、3.30%となります。

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。
手数料について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（後略）

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】

<更新後>

（前略）

ファンドの特色

（中略）

⚠️ マン・グループとは？



専門性の高い運用エンジンによる先進的な資産運用機能を提供

- 1783年に樽メーカー／砂糖の仲買業者として創業
- ロンドンに本社を置き、世界の主要都市に拠点を構える。
- ロンドン市場等に上場、FTSE250指数の構成銘柄（ティッカー：EMG）
- 2007年にオックスフォード大学と共同でオックスフォード・マン定量ファイナンス研究所（OMI）を設立、現在は人工知能／機械学習の金融分野への応用に注力

※2019年6月末現在 出所：マン・グループ

⚠️ マン・グループの「スタイル・リスク・プレミア戦略」とは？

『共通の勝ちパターン』を記憶するそれぞれのロボットが、24時間世界中の市場を監視し、運用を行います。

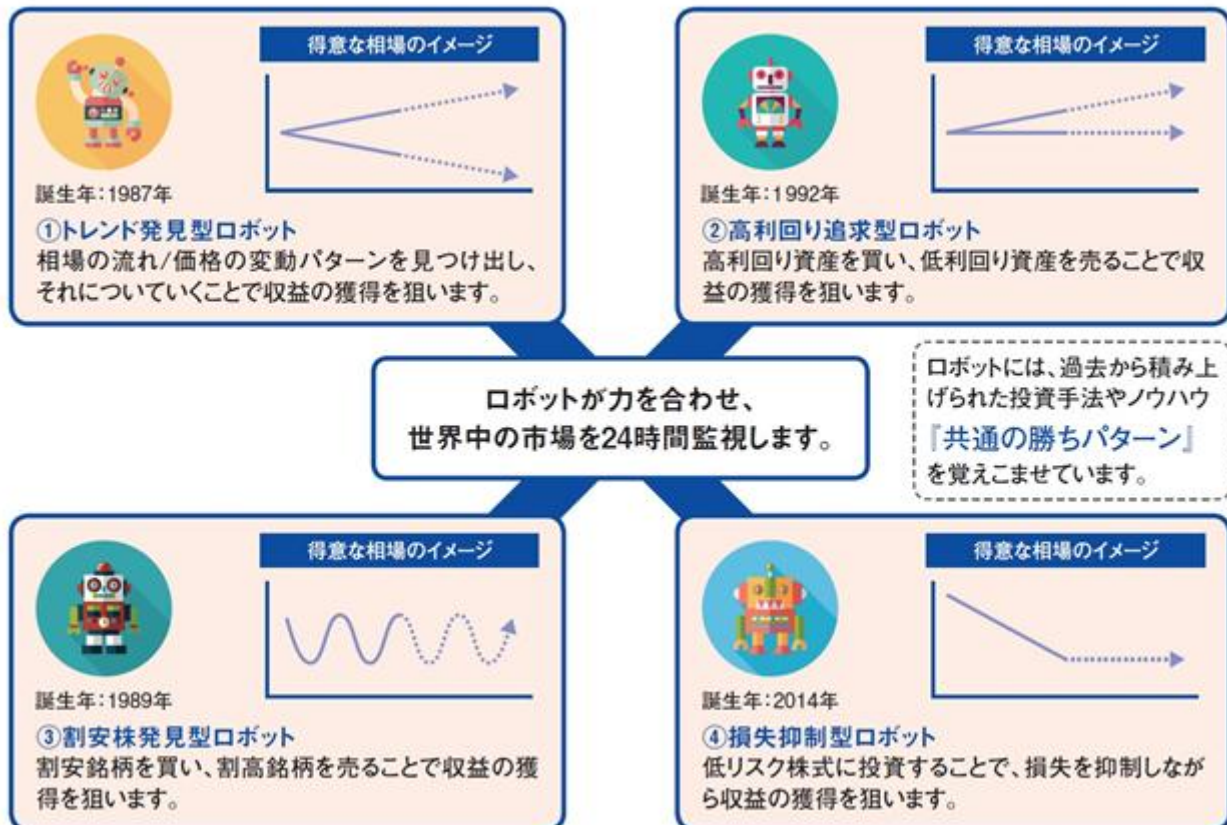
- 投資判断、取引の執行など全てロボットが行っていきます（『ロボット自動運用型』）。
 - ・ ロボットは、英国のマン・グループが長年培ってきた様々なシステムにより運用を行います。取引執行に係るコストを大幅に引き下げる工夫も行われています。
 - ・ 英国オックスフォード大学などとも共同で開発した金融技術も駆使しています。
- 世界中の様々な市場に分散投資を行うとともに、あらゆる市場局面に対応するために、複数のタイプのロボットが異なる目線で市場を24時間監視し続けます。
 - ・ 先物取引等を活用することで、例えば、相場の上昇局面だけでなく、相場の下落局面でも収益獲得を狙うことが可能となります。
 - ・ 伝統的資産との相関が低く、分散効果が期待されます。
- ロボットは、欲や恐怖といった感情を持ちません。疲れも知りません。与えられたルールに従い、眠らずに働くことができます。

リスクのコントロールもロボットが行います。もちろん、ロボットの動きに不具合がないかは、常に人間の目でも監視を行います。



※上記はマン・グループの「スタイル・リスク・プレミア戦略」を説明するためのイメージ図であり、全てを説明しているものではありません。また、「共通の勝ちパターン」とは、資産運用において広く有効と考えられる投資手法をルール化したものであり、中長期的な収益の源泉と考えますが、個々の収益が獲得されること、またこれらを組み合わせることによる収益の獲得を保証するものではありません。

出所：マン・グループ



■（ご参考）自動運用ロボットの各運用戦略の構成

ロボットのタイプ	運用戦略の概要	投資対象	戦略開始
 ①トレンド発見型ロボット	以下の2つの戦略から構成		
	①主要資産の相場の流れ(トレンド)に追随する運用	株価指数 債券 通貨	1987年
	②主要資産における季節性を持った価格変動を利用する運用	株価指数 債券 通貨	2011年
 ②高利回り追求型ロボット	以下の3つの戦略から構成		
	①先進国の割安通貨の買い&先進国の割高通貨の売り	通貨	1992年
	②先進国の高利回り債券の買い&先進国の低利回り債券の売り	債券	2007年
	③米国株式(S&P500)の予想変動率指数(VIX)の売り	VIX先物	2006年
 ③割安株発見型ロボット	以下の3つの戦略から構成		
	①先進国株式を対象に割安株の買い&割高株の売り	株式個別銘柄	1989年
	②先進国株式を対象に質の高い小型株を買い&質の低い大型株を売り	株式個別銘柄	2010年
	③先進国株式を対象に質が高く価格の上昇トレンドがある株を買い&質が低く価格の下落トレンドがある株を売り	株式個別銘柄	2004年
 ④損失抑制型ロボット	先進国株式を対象とした値動きの小さい(低リスク)株の買い&値動きの大きい(高リスク)株の売り	株式個別銘柄	2014年

※マン・グループでは、収益機会を捉えるためのモデルの研究・開発を日夜行っております。新たな戦略が追加される等、将来的に運用戦略の構成の変更が行われる可能性があります。

※上記はマン・グループの「スタイル・リスク・プレミア戦略」を説明するためのイメージ図であり、全てを説明しているものではありません。また、「共通の勝ちパターン」とは、資産運用において広く有効と考えられる投資手法をルール化したものであり、中長期的な収益の源泉と考えますが、個々の収益が獲得されること、またこれらを組み合わせることによる収益の獲得を保障するものではありません。

出所：マン・グループ

(2) 【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

平成30年1月19日 投資信託契約締結、設定・運用開始

< 訂正後 >

2018年1月19日 投資信託契約締結、設定・運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(前略)

委託会社の概況

1) 資本金の額 (平成30年12月末日現在)

資本金 150百万円

2) 会社の沿革

平成18年12月28日 : 「楽天投信株式会社」設立

平成20年 1月31日 : 金融商品取引業者登録 [関東財務局長(金商)第1724号]

平成21年 4月 1日 : 株式会社ポーラスター投資顧問と合併、商号を「楽天投信投資顧問株式会社」に変更

3) 大株主の状況 (平成30年12月末日現在)

名称	住所	所有株式数	所有比率
楽天株式会社	東京都世田谷区玉川一丁目14番1号	13,000 株	100 %

< 訂正後 >

(前略)

委託会社の概況

1) 資本金の額 (2019年6月末日現在)

資本金 150百万円

2) 会社の沿革

2006年12月28日 : 「楽天投信株式会社」設立

2008年 1月31日 : 金融商品取引業者登録 [関東財務局長(金商)第1724号]

2009年 4月 1日 : 株式会社ポーラスター投資顧問と合併、商号を「楽天投信投資顧問株式会社」に変更

3) 大株主の状況 (2019年6月末日現在)

名称	住所	所有株式数	所有比率
楽天カード株式会社	東京都世田谷区玉川一丁目14番1号	13,000 株	100 %

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

(前略)

投資態度

(中略)

平成30年12月末日現在、「別に定める投資信託証券」とは、以下の通りとします。

アイルランド籍外国投資法人「マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラスI H 日本円シェアーズ）」の受益証券

(後略)

<訂正後>

(前略)

投資態度

(中略)

2019年6月28日現在、「別に定める投資信託証券」とは、以下の通りとします。

アイルランド籍外国投資法人「マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラスI H 日本円シェアーズ）」の受益証券

(後略)

(2)【投資対象】

<訂正前>

(前略)

投資対象とする投資信託証券の概要

下記概要は、平成30年12月末日現在のものであり、今後、記載事項は変更になる場合があります。

(中略)

上記概要は、2018年12月28日現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しておりますが、今後内容が変更になる場合があります。

<訂正後>

(前略)

投資対象とする投資信託証券の概要

下記概要は、2019年6月28日現在のものであり、今後、記載事項は変更になる場合があります。

(中略)

上記概要は、2019年6月28日現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しておりますが、今後内容が変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

<訂正前>

(前略)

運用体制は平成30年12月末現在のものであり、今後、変更になる場合があります。

(後略)

<訂正後>

(前略)

運用体制は2019年6月末現在のものであり、今後、変更になる場合があります。

(後略)

3 【投資リスク】

<更新後>

(前略)

(2) リスク管理体制

(中略)

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



- ※上記5年間の各月末における直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。(当ファンドの設定日以降で、算出可能な期間についてのみ表示しています。)
- ※当ファンドの年間騰落率は、分配金再投資基準価額に基づいて計算した騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。(分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。)

■ ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- ※当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、上記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、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。なお、当ファンドの騰落率は、設定日以降で算出可能な期間のみであり、代表的な資産クラスの対象期間と異なります。
当ファンドの対象期間:2019年1月～2019年6月
代表的な資産クラスの対象期間:2014年7月～2019年6月
- ※当ファンドの年間騰落率は、分配金再投資基準価額に基づいて計算した騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの騰落率は以下の各指数の騰落率です。

日本株……S&P日本総合指数(トータル・リターン、円ベース)

先進国株…S&P先進国総合指数(除く日本、トータル・リターン、円換算ベース)

新興国株…S&P新興国総合指数(トータル・リターン、円換算ベース)

日本国債…ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル国債:日本インデックス(円ベース)

先進国債…ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル国債(日本除く)インデックス(円ベース)

新興国債…ブルームバーグ・バークレイズ新興市場自国通貨建て高流動性国債インデックス(円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※上記各指数に関する知的財産権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料は、申込金額（取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た金額）に、3.24%（税込）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た金額となります。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

（後略）

<訂正後>

申込手数料は、申込金額（取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た金額）に、3.24%－（税込）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た金額となります。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

消費税率が10%となった場合は、3.30%となります。

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

（後略）

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年0.918%（税抜0.85%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分および当該信託報酬を対価とする役務の内容は次のとおりとします。

委託会社	年0.243%（税抜0.225%）	委託した資金の運用の対価
販売会社	年0.648%（税抜0.60%）	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年0.027%（税抜0.025%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了時に投資信託財産中から支弁するものとします。また、信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産から支弁します。

当ファンドの信託報酬のほかに、当ファンドが投資する投資信託証券で、純資産総額に対して以下の信託報酬等が別途かかります。従って、当ファンドにおける実質的な信託報酬率は年2.118%（税込）程度です。

投資信託証券における信託報酬／管理報酬等

ファンド名	信託報酬／管理報酬等（年）
マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラスIH 日本円シェアーズ）	1.2%程度
楽天・国内マネー・マザーファンド	なし

上記のほか、監査報酬等の諸費用が別途かかる場合があります。

投資信託証券の信託報酬等については、「2 投資方針（2）投資対象 投資対象とする投資信託証券の概要」をご参照ください。

* 税額は、平成30年12月末日現在のものであり、税法が改正された場合、その内容が変更されることがあります。

< 訂正後 >

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年0.918%－（税抜0.85%）の率を乗じて得た額とします。

消費税率が10%となった場合は、年0.935%となります。

信託報酬の配分および当該信託報酬を対価とする役務の内容は次のとおりとします。

委託会社	年0.225%（税抜）	委託した資金の運用の対価
販売会社	年0.60%（税抜）	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年0.025%（税抜）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了時に投資信託財産中から支弁するものとします。また、信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産から支弁します。

当ファンドの信託報酬のほかに、当ファンドが投資する投資信託証券で、純資産総額に対して以下の信託報酬等が別途かかります。従って、当ファンドにおける実質的な信託報酬率は年2.118%－（税込）程度^{（注1）}です。

消費税率が10%となった場合は、年2.135%（税込）程度となります。

投資信託証券における信託報酬 / 管理報酬等

ファンド名	信託報酬 / 管理報酬等（年） ^{（注2）}
マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラスI H 日本円シェアーズ）	1.2%程度
楽天・国内マネー・マザーファンド	なし

上記のほか、監査報酬等の諸費用が別途かかる場合があります。

投資信託証券の信託報酬等については、「2 投資方針（2）投資対象 投資対象とする投資信託証券の概要」をご参照ください。

（注1）実質的な信託報酬率は、投資する投資信託証券における報酬を加味した実質的な信託報酬の概算値です。この値は目安であり、実際の投資信託証券の組入状況、運用状況等によって変動します。

（注2）2019年6月28日現在。今後、投資内容等によりこの数値は変動します。

* 税額は、2019年6月末日現在のものであり、税法が改正された場合、その内容が変更されることがあります。

5【運用状況】

<更新後>

(1)【投資状況】

(2019年6月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託証券	750,709,710	98.48
内 アイルランド	750,709,710	98.48
親投資信託受益証券	998,902	0.13
内 日本	998,902	0.13
短期金融資産、その他（負債控除後）	10,551,506	1.39
純資産総額	762,260,118	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2019年6月28日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
1 アイル ランド	投資信託 証券	マン・ファンズ・ ・ピーエルシー - マン・オルタナティ ブ・スタイル・リス ク・プレミア(クラ スIH日本円シェア ズ)	81,210.83	8,960.38	727,679,941	9,243.96	750,709,710	98.48
2 日本	親投資信託 受益証券	楽天・国内マネー・ マザーファンド	997,905.00	1.0014	999,302	1.0010	998,902	0.13

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率(%)
投資信託証券	98.48
親投資信託受益証券	0.13
合計	98.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

【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】

2019年6月28日現在および同日前1年以内における各月末営業日及び各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額		1口当たりの純資産額	
	(分配落) (円)	(分配付) (円)	(分配落) (円)	(分配付) (円)
設定時 (2018年1月19日)	464,757,915	-	1.0000	-
6月末日	1,173,277,085	-	0.9327	-
7月末日	1,256,757,665	-	0.9454	-
8月末日	1,335,065,777	-	0.9317	-
9月末日	1,338,447,729	-	0.9297	-
10月末日	1,082,474,905	-	0.9011	-
第1計算期間末 (2018年11月20日)	1,047,592,646	1,047,592,646	0.8915	0.8915
11月末日	993,116,756	-	0.8899	-
12月末日	911,918,822	-	0.8775	-
2019年1月末日	885,595,473	-	0.8918	-
2月末日	864,711,533	-	0.8996	-
3月末日	815,508,344	-	0.8964	-
4月末日	777,690,578	-	0.8909	-
5月末日	770,105,251	-	0.9057	-
6月末日	762,260,118	-	0.9133	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2018年11月21日～ 2019年5月20日	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	10.9
2018年11月21日～ 2019年5月20日	0.9

(注) 収益率とは、各計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額)を基準とした、各計算期間末の基準価額(分配付)の上昇(または下落)率をいいます。なお、収益率は小数第2位を四捨五入しています。

(参考情報) 運用実績

2019年6月28日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移



基準価額	9,133円
純資産総額	762百万円

※「分配金再投資基準価額」は、税引前分配金を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。

※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	第1期 2018年11月	設定来累計
分配金	0円	0円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

銘柄名	種類	国/地域	通貨	投資比率
マン・ファンズ・VI・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア(クラスIH日本円シェアーズ)	投資信託証券	アイルランド	円	98.5%
楽天・国内マネー・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	円	0.1%
短期金融資産、その他				1.4%
合計				100.0%

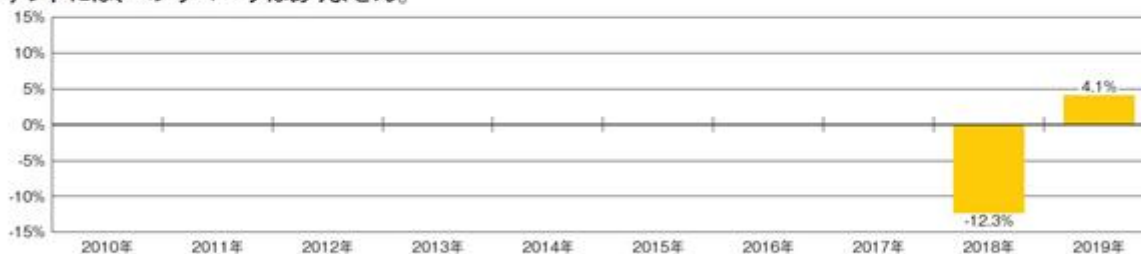
※投資比率は、純資産総額に対する各資産の評価額の比率です。

※投資比率は、小数点第2位を四捨五入しています。

※国/地域は、各投資信託証券の発行地です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

当ファンドには、ベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「税引前分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2018年は設定日(2018年1月19日)から年末まで、2019年は6月末までの騰落率を表しています。

最新の運用状況については、委託会社のホームページにてご確認ください。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	1,636,991,312	461,926,742	1,175,064,570
2018年11月21日～ 2019年5月20日	26,945,094	336,127,599	865,882,065

(注) 当初申込期間中の設定数量は464,757,915口です。

（参考）楽天・国内マネー・マザーファンド**（1）投資状況**

（2019年6月28日現在）

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
現先取引	1,501,006,852	65.17
内 日本	1,501,006,852	65.17
短期金融資産、その他（負債控除後）	802,230,224	34.83
純資産総額	2,303,237,076	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（2019年6月28日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第803回国庫短期証 券 日本	債券現先 -	1,000,000,000	- 1,001,007,000	- 1,001,007,000	- -	43.46
2	T&Dリース01HB 日本	CP現先 -	500,000,000	- 499,999,852	- 499,999,852	- -	21.71

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率(%)
債券現先	43.46
CP現先	21.71
合計	65.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（前略）

- （4）申込手数料は、申込金額（取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た金額）に、3.24%（税抜3.00%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た金額となります。

税法が改正された場合等には、上記手数料が変更になることがあります。

（後略）

<訂正後>

（前略）

- （4）申込手数料は、申込金額（取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た金額）に、3.24%（税抜3.00%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た金額となります。

消費税率が10%となった場合は、3.30%となります。

税法が改正された場合等には、上記手数料が変更になることがあります。

（後略）

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当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）（以下「中間財務諸表等規則」という。）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）（以下、「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間（平成30年11月21日から令和元年5月20日まで）の中間財務諸表については、EY新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【楽天グローバル・プレミア・ファンド(ロボット自動運用型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期計算期間末 平成30年11月20日現在	第2期中間計算期間末 令和元年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,060,425	19,266,001
投資信託受益証券	998,332,422	765,223,131
親投資信託受益証券	999,302	999,002
未収入金	40,000,000	-
流動資産合計	1,052,392,149	785,488,134
資産合計		
	1,052,392,149	785,488,134
負債の部		
流動負債		
未払解約金	68,303	2,042,439
未払受託者報酬	115,368	116,561
未払委託者報酬	3,807,212	3,846,603
その他未払費用	808,620	504,251
流動負債合計	4,799,503	6,509,854
負債合計		
	4,799,503	6,509,854
純資産の部		
元本等		
元本	1,175,064,570	865,882,065
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	127,471,924	86,903,785
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	1,047,592,646	778,978,280
純資産合計		
	1,047,592,646	778,978,280
負債純資産合計		
	1,052,392,149	785,488,134

（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		第2期中間計算期間	
	自	平成30年1月19日 至 平成30年7月18日	自	平成30年11月21日 至 令和元年 5月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		44,087,642		10,890,409
営業収益合計		44,087,642		10,890,409
営業費用				
支払利息		29,575		8,063
受託者報酬		130,755		116,561
委託者報酬		4,314,725		3,846,603
その他費用		387,930		505,208
営業費用合計		4,862,985		4,476,435
営業利益又は営業損失（ ）		48,950,627		6,413,974
経常利益又は経常損失（ ）		48,950,627		6,413,974
中間純利益又は中間純損失（ ）		48,950,627		6,413,974
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（ ）		3,575,196		645,076
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		127,471,924
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,298,332		36,475,757
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,298,332		36,475,757
剰余金減少額又は欠損金増加額		25,588,970		2,966,668
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		25,588,970		2,966,668
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		69,666,069		86,903,785

(3) 【中間注記表】

(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	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の市場価格又は基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>1. 金融商品の時価に関する補足情報 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>2. 剰余金又は欠損金 中間貸借対照表における剰余金又は欠損金について、「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3条の2に基づき、当中間計算期間末の中間剰余金又は中間欠損金の比較情報として、前計算期間末の剰余金又は欠損金を開示しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期中間計算期間末 平成30年11月20日現在	第2期中間計算期間末 令和元年5月20日現在
1. 受益権総数	1,175,064,570口	865,882,065口
2. 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127,471,924円です。	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86,903,785円です。
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8915円 (8,915円)	0.8996円 (8,996円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期中間計算期間 自 平成30年 1月19日 至 平成30年 7月18日	第2期中間計算期間 自 平成30年11月21日 至 令和元年 5月20日
該当事項はありません。	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

項目	第1期計算期間末 平成30年11月20日現在	第2期中間計算期間末 令和元年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額と時価との差額	貸借対照表計上額は原則として時価で計上されているため、差額はありません。	中間貸借対照表計上額は原則として時価で計上されているため、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 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)上記以外の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)上記以外の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期計算期間末 平成30年11月20日現在	第2期中間計算期間末 令和元年5月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第1期計算期間 自平成30年1月19日 至平成30年11月20日	第2期中間計算期間 自平成30年11月21日 至令和元年5月20日
元本の推移		
期首元本額	464,757,915円	1,175,064,570円
期中追加設定元本額	1,172,233,397円	26,945,094円
期中一部解約元本額	461,926,742円	336,127,599円

（参考情報）

「楽天グローバル・プレミア・ファンド（ロボット自動運用型）」は、「マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラス I H 日本円シェアーズ）」投資信託受益証券、「楽天・国内マネー・マザーファンド」親投資信託受益証券を主要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」および「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの投資信託受益証券および親投資信託受益証券です。

「マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラス I H 日本円シェアーズ）」および「楽天・国内マネー・マザーファンド」の状況は次の通りです。また、「マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラス I H 日本円シェアーズ）」については当ファンド（楽天グローバル・プレミア・ファンド（ロボット自動運用型））の当作成期末において、「マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア（クラス I H 日本円シェアーズ）」の入手可能な直前計算期間の年次報告書の情報を基に掲載しています。なお、以下に記載した情報は監査の対象外です。

マン・ファンズ・ピーエルシー - マン・オルタナティブ・スタイル・リスク・プレミア

貸借対照表

2018年12月31日現在

マン・オルタナティブ・
スタイル・リスク・プレミア
(米ドル)

資産

現金及び現金同等物	56,593,749
ブローカーで保有されている残高	17,380,422
損益を通じて公正価値で測定される金融資産：	
株式及びマネージド・ファンド	196,628,941
利付き証券	39,825,776
デリバティブ	36,851,923
未収申込金	2,880,680
その他の資産	368,226
資産合計	350,529,717

負債

ブローカーに対する債務残高	24,011,550
ブローカーに対する債務	1,182
損益を通じて公正価値で測定される金融負債：	
デリバティブ	10,872,840
未払買戻し代金	2,935,315
未払管理報酬	248,312
未払費用及びその他の負債	419,725

負債合計

(買戻し可能株式の保有者に帰属する純資産を除く)	38,488,924
買戻し可能株式の保有者に帰属する純資産	312,040,793

包括利益計算書

2018年12月31日に終了する年度

マン・オルタナティブ・
スタイル・リスク・プレミア
(米ドル)

収益	
損益を通じて公正価値で測定される 金融資産の純（損失）/収益	(30,612,679)
費用の払い戻し	590,130
その他の収益	720
	(30,021,829)

費用	
管理報酬	2,014,448
事務管理報酬	602,693
その他の費用	156,362
保管報酬	144,472
法務報酬	53,468
監査報酬	18,094
設立費用	16,667
ディレクターの報酬	631
取引費用及び仲介費用	2,650
	3,009,485

当年度/期間の買戻し可能参加型株式の保有者に帰属する
純（損失）/利益 (33,031,314)

当年度/期間において認識された全ての利益及び損失は、継続している事業（当年度に運用を中止した
ポートフォリオを除く）からのみ生じたものである。

投資資産明細

2018年12月31日現在

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

額面 銘柄	公正価格 (米ドル)	純資産総額 比率(%)	額面 銘柄	公正価格 (米ドル)	純資産総額 比率(%)
差金決済取引(b)			株式(続き)		
ベルギー			フィンランド		
(30,521) Ageas	266,558	0.09	11,972 DNA OYJ	233,753	0.07
(27,111) Groupe Bruxelles Lambert SA	471,318	0.15	116,652 Neste OYJ	8,982,505	2.88
	737,876	0.24		9,216,258	2.95
デンマーク			ドイツ		
(72,483) DSV A/S	1,822,984	0.59	35,436 Aurubis AG	1,750,785	0.56
(49,178) Jyske Bank A/S	912,712	0.29	3,847 Brenntag AG	165,793	0.05
	2,735,696	0.88	9,130 Carl Zeiss Meditec AG	712,844	0.23
フェロー諸島			17,216 Compugroup Medical SE	795,878	0.26
(103,008) Bakkafrost P/F	915,091	0.29	77,217 Covestro AG	3,811,525	1.22
フィンランド			49,422 CTS Eventim AG & Company KGaA	1,840,664	0.59
(11,972) DNA OYJ	24,642	0.01	39,071 Deutsche Pfandbriefbank AG	390,363	0.13
(116,652) Neste OYJ	195,757	0.06	876,148 Deutsche Telekom AG	14,843,247	4.76
	220,399	0.07	42,728 Deutsche Wohnen SE NPV (BR)	1,953,781	0.63
ドイツ			28 Evonik Industries AG	698	0.00
(35,436) Aurubis AG	183,153	0.06	7,866 Hannover Rueck SE	1,058,361	0.34
(3,847) Brenntag AG	73,189	0.02	35,716 Hella GmbH & Company KGaA	1,420,840	0.46
(77,217) Covestro AG	1,507,450	0.48	47,578 Henkel AG & Company KGaA	4,663,839	1.49
(49,422) CTS Eventim AG & Company KGaA	245,263	0.08	18,934 LEG Immobilien AG	1,972,238	0.63
(39,071) Deutsche Pfandbriefbank AG	198,314	0.06	20,896 Morphosys AG	2,124,772	0.68
(42,728) Deutsche Wohnen SE	57,781	0.02	886 Puma SE	432,479	0.14
(28) Evonik Industries AG	311	0.00	46,133 Rheinmetall AG	4,069,182	1.30
(35,716) Hella GmbH & Company KGaA	64,356	0.02	360,448 Scout24 AG	16,547,773	5.3
(47,578) Henkel AG & Company KGaA	531,038	0.17	21,323 Software AG	770,018	0.25
(18,934) LEG Immobilien AG	298,999	0.10	43,853 Tag Immobilien AG	998,099	0.32
(20,896) MorphoSys AG	555,379	0.18	202,351 Talanx AG	6,893,263	2.21
(886) Puma SE	17,139	0.01		67,216,442	21.55
(46,133) Rheinmetall AG	1,499,529	0.49	ルクセンブルグ		
(130,284) Schaeffler AG	30,276	0.01	367,705 Grand City Properties SA	7,965,480	2.55
(360,448) Scout24 AG	411,408	0.13	オランダ		
(21,323) Software AG	260,206	0.08	296,921 ASM International NV	12,287,194	3.94
(43,853) TAG Immobilien AG	38,945	0.01	234,383 ASR Nederland NV	9,265,190	2.97
(202,351) Talanx AG	753,135	0.24	154,782 Koninklijke Ahold Delhaize NV	3,905,929	1.25
	6,725,871	2.16		25,458,313	8.16
ルクセンブルグ			ノルウェー		
(367,705) Grand City Properties	1,623,236	0.52	67,180 Aker ASA	3,584,320	1.15
オランダ			4,565,099 DNO ASA	6,616,353	2.12
(296,921) ASM International NV	106,915	0.03	332,139 Grieg Seafood ASA	3,923,921	1.26
(234,383) ASR Nederland NV	1,592,093	0.51	1,423,404 Leroy Seafood Group ASA	10,839,316	3.47
	1,699,008	0.54	20,080 Orkla ASA	157,780	0.05
ノルウェー			131,987 Salmar ASA	6,523,785	2.09
(67,180) Aker ASA-A Shares	1,346,352	0.43	436,102 Telenor ASA	8,435,826	2.70
(4,565,099) DNO ASA	1,735,042	0.56		40,081,301	12.84
(332,139) Grieg Seafood ASA	387,788	0.12	スウェーデン		
(1,423,404) Leroy Seafood Group ASA	239,114	0.08	13,489 Alfa Laval AB	288,544	0.09
(20,080) Orkla ASA	19,402	0.01	365,700 Swedish Orphan Biovitrum AB	7,960,895	2.55
(131,987) Salmar ASA	138,492	0.04		8,249,439	2.64
(436,102) Telenor ASA	33,364	0.01	スイス		
	3,899,554	1.25	19,191 Flughafen Zuerich AG	3,163,459	1.01
スウェーデン			1,863 Georg Fischer AG	1,486,356	0.48
(13,489) Alfa Laval AB	56,829	0.02	12 Givaudan SA	27,705	0.01
(365,700) Swedish Orphan Biovitrum AB	1,663,682	0.53	62,763 Novartis AG	5,350,581	1.71
	1,720,511	0.55	41,787 Psp Swiss Property AG	4,105,367	1.32
スイス			13,192 Schindler Holding AG	2,550,614	0.82
(19,191) Flughafen Zurich AG	859,787	0.27		16,684,082	5.35
(1,863) Georg Fischer AG	845,340	0.27	株式合計		
(12) Givaudan SA	1,522	0.00		195,518,190	62.66
			先物取引(a)		
			オーストラリア		

(13,192) Schindler Holding AG	305,010	0.10
	<u>2,011,659</u>	<u>0.64</u>
差金決済取引合計	<u>22,288,901</u>	<u>7.14</u>
株式		
ベルギー		
30,521 Ageas	1,371,180	0.44
27,111 Groupe Bruxelles Lambert SA	2,357,867	0.76
65,590 UCB SA	5,346,018	1.71
	<u>9,075,065</u>	<u>2.91</u>
デンマーク		
72,483 DSV A/S	4,765,616	1.53
49,178 Jyske Bank A/S	1,771,868	0.57
	<u>6,537,484</u>	<u>2.10</u>
フェロー諸島		
103,008 Bakkafrost P/F	5,034,326	1.61

725 Australian 10 Years Bond Futures March 2019	765,833	0.24
369 Australian 3 Years Bond Futures March 2019	119,825	0.04
	<u>885,658</u>	<u>0.28</u>

カナダ

(13) S&P/TSX 60 IX Futures March 2019	32,659	0.02
---------------------------------------	--------	------

欧州連合(EU)

362 3MO Euro EURIBOR December 2020	125,704	0.05
475 3MO Euro EURIBOR March 2020	107,699	0.03
248 3MO Euro EURIBOR September '1 (Perpetual)	100,683	0.03
	<u>334,086</u>	<u>0.11</u>

フランス

(21) CAC40 10 Euro Futures January 2019	11,294	0.00
---	--------	------

ドイツ

(8) DAX Index Futures March 2019	44,354	0.01
30 Euro BUXL 30 Years Bond Futures March 2019	86,034	0.03

投資資産明細(続き)

2018年12月31日現在

損益を通じて公正価値で測定する金融資産(続き)

額面 銘柄	公正価格 (米ドル)	純資産総額 比率(%)
先物取引(a)(続き)		
ドイツ(続き)		
(80) Euro STOXX 50 March 2019	72,064	0.02
212 Euro-BOBL Futures March 2019	76,488	0.02
118 Euro-BTP Futures March 2019	662,673	0.22
129 Euro-BUND Futures March 2019	156,543	0.06
210 Euro-SCHATZ Index Futures March 2019	11,883	0.00
	<u>1,110,039</u>	<u>0.36</u>
イタリア		
(15) FTSE/MIB Index Futures March 2019	44,354	0.02
日本		
10 Japan 10 Years Bond (OSE) Future March 2019	43,249	0.01
(9) TOPIX Index Futures March 2019	86,009	0.03
	<u>129,258</u>	<u>0.04</u>
オランダ		
(8) Amsterdam Index Futures January 2019	13,315	0.00
シンガポール		
(10) NIKKEI 225 (SGX) March 2019	68,155	0.02
韓国		
5 Korea 10 Years Bond Futures March 2019	2,151	0.00
(68) KOSPI2 Index Futures March 2019	29,566	0.01
	<u>31,717</u>	<u>0.01</u>
スペイン		
(15) IBEX 35 Index Futures January 2019	36,827	0.01
スウェーデン		
(60) OMXS30 Index Futures January 2019	28,065	0.01
イギリス		
142 90 Day Sterling Future December 2020	16,016	0.01
170 90 Day Sterling Future March 2020	10,181	0.00
(26) FTSE 100 Index Futures March 2019	4,878	0.00
66 Long Gilt Future March 2019	77,893	0.02
	<u>108,968</u>	<u>0.03</u>
アメリカ		
51 90 Day EURO\$ Futures December 2020	46,587	0.01
121 90 Day EURO\$ Futures June 2019	51,425	0.02
4 90 Day EURO\$ Futures June 2 (Perpetual)	1,725	0.00
48 90 Day EURO\$ Futures March 2020	19,269	0.01
60 90 Day EURO\$ Futures September 1 (Perpetual)	42,087	0.01
(6) CBOE VIX Futures February 2019	450	0.00
(21) E-Mini Russell 2000 March 2019	68,845	0.02
(17) MSCI EAFE March 2019	27,775	0.01
(29) MSCI Emerging Market Index March 2019	5,965	0.00
(10) NASDAQ 100 E-Mini Index Futures March 2019	55,248	0.02
(22) S&P500 Emini Futures March 2019	106,738	0.03
109 United States 2 Years Note (CBT) March 2019	113,258	0.04
117 United States 5 Years Note (CBT) March 2019	130,511	0.05
40 United States Long Bond (CBT) March 2019	103,797	0.03
	<u>773,680</u>	<u>0.25</u>
先物取引合計	<u>3,608,075</u>	<u>1.16</u>
国債		
アメリカ		
10,000,000 United States Treasury Bill 0% 02/05/2019#	9,920,507	3.18
10,000,000 United States Treasury Bill 0% 07/03/2019	9,958,327	3.19
5,000,000 United States Treasury Bill 0% 11/04/2019#	4,967,843	1.59
15,000,000 United States Treasury Bill 0% 24/01/2019	14,979,099	4.80
	<u>39,825,776</u>	<u>12.76</u>
国債合計	<u>39,825,776</u>	<u>12.76</u>

優先株			
ドイツ			
130,284	Schaeffler AG	<u>1,110,751</u>	<u>0.36</u>
優先株合計		<u>1,110,751</u>	<u>0.36</u>
トータル・リターン・スワップ (b)			
アメリカ			
2,037,464	AHL MRPO MS SWAP	<u>1,888,729</u>	<u>0.61</u>
トータル・リターン・スワップ合計		<u>1,888,729</u>	<u>0.61</u>

投資資産明細(続き)

2018年12月31日現在

損益を通じて公正価値で測定する金融資産(続き)

為替先渡契約(注4)**(b)

未収金額	未払金額	償還日	契約数	未実現収益 (米ドル)	純資産総額 比率(%)
CHF112,691	€100,000	04 January 2019	1	6	0.00
CHF14,189,923	€12,500,000	10 January 2019	16	106,744	0.03
CHF18,800,000	US\$18,930,371	09 January 2019	41	156,811	0.05
CHF1,383,552	US\$1,393,431	31 January 2019	1	14,177	0.00
CNY9,000,000	US\$1,307,737	18 January 2019	11	2,205	0.00
€600,000	CHF675,548	03 January 2019	1	582	0.00
€300,000	CHF337,363	10 January 2019	1	683	0.00
€22,500,000	£20,007,454	11 January 2019	97	249,052	0.09
€2,500,000	US\$2,847,435	09 January 2019	16	12,576	0.00
€1,640,954	US\$1,875,049	17 January 2019	1	3,518	0.00
€57,890,586	US\$65,895,387	31 January 2019	4	458,802	0.15
£400,000	AUD700,347	03 January 2019	4	16,442	0.01
£1,950,000	AUD3,492,644	30 January 2019	30	26,936	0.01
£50,000	US\$63,292	03 January 2019	1	397	0.00
£1,600,000	US\$2,021,053	11 January 2019	11	17,829	0.01
£1,354	US\$1,709	17 January 2019	3	17	0.00
£6,674	US\$8,440	31 January 2019	1	73	0.00
JPY968,189,631	€7,600,000	04 January 2019	59	137,054	0.04
JPY37,866,300	€300,000	07 January 2019	3	2,214	0.00
JPY2,212,547,698	€17,300,000	11 January 2019	76	390,678	0.13
JPY183,056,685	£1,300,000	04 January 2019	20	13,082	0.00
JPY21,003,615	£150,000	07 January 2019	3	455	0.00
JPY531,678,556	£3,750,000	31 January 2019	6	74,357	0.02
JPY40,000,000	US\$356,805	04 January 2019	3	7,910	0.00
JPY70,000,000	US\$634,712	07 January 2019	5	3,716	0.00
JPY3,040,000,000	US\$27,263,042	11 January 2019	234	471,325	0.15
JPY36,700	US\$328	17 January 2019	1	7	0.00
JPY11,596,228,313	US\$102,693,300	31 January 2019	9	3,260,289	1.04
KRW2,612,313,433	US\$2,338,930	10 January 2019	22	5,082	0.00
MXN87,000,000	US\$4,316,272	09 January 2019	87	96,061	0.03
SEK1,000,000	US\$110,441	03 January 2019	2	2,380	0.00
SEK294,000,000	US\$33,051,574	18 January 2019	74	159,419	0.05
SEK394,987	US\$43,714	31 January 2019	3	952	0.00
SGD1,000,000	US\$731,473	25 January 2019	10	2,606	0.00
US\$78,605	AUD111,000	02 January 2019	1	458	0.00
US\$5,246,588	AUD7,400,000	03 January 2019	55	36,671	0.01
US\$2,809,948	AUD3,902,349	17 January 2019	4	61,719	0.02
US\$18,797	AUD26,136	31 January 2019	2	385	0.00
US\$14,560,216	AUD20,100,000	28 February 2019	15	394,138	0.13
US\$146,658	CAD200,000	02 January 2019	2	217	0.00
US\$1,407,293	CAD1,900,000	03 January 2019	18	16,062	0.01
US\$34,028,487	CAD44,600,000	09 January 2019	52	1,366,140	0.44
US\$1,078,987	CAD1,429,305	17 January 2019	1	32,025	0.01
US\$56,167,582	CHF55,300,000	09 January 2019	13	22,838	0.01
US\$9,643	CHF9,476	31 January 2019	1	2	0.00
US\$18,092,663	€15,800,000	09 January 2019	7	17,397	0.01
US\$451,912	€392,319	31 January 2019	3	2,236	0.00
US\$50,316,649	£38,650,000	11 January 2019	52	1,064,900	0.34
US\$3,209,750	£2,500,000	31 January 2019	1	20,725	0.01
US\$4,026,945	NOK33,500,000	30 January 2019	2	152,740	0.05
US\$2,026,922	NZD3,000,000	03 January 2019	21	15,143	0.00
US\$268,655	NZD400,000	04 January 2019	4	412	0.00
US\$9,296,709	NZD13,600,000	28 February 2019	7	167,573	0.05
為替先渡取引に係わる未実現収益の合計				9,066,218	2.90
損益を通じて公正価値で評価される金融資産の 合計(売買目的)				273,306,640	87.59

投資資産明細(続き)

2018年12月31日現在

損益を通じて公正価値で測定する金融資産(続き)

額面 銘柄	公正価格 (米ドル)	純資産総額 比率(%)
基金決済取引		
ベルギー		
(65,590) UCB SA	(42,989)	(0.01)
ドイツ		
(9,130) Carl Zeiss Meditec AG	(10,013)	(0.00)
(17,216) Compugroup Medical SE	(29,098)	(0.01)
(876,148) Deutsche Telekom AG	(126,146)	(0.05)
(7,866) Hannover Rueck SE	(12,839)	(0.00)
	(178,096)	(0.06)
オランダ		
(154,782) Koninklijke Ahold Delhaize NV	(24,611)	(0.01)
スイス		
(62,763) Novartis AG	(186,902)	(0.06)
(41,787) Psp Swiss Property AG	(39,251)	(0.01)
	(226,153)	(0.07)
基金決済取引合計		
	(471,849)	(0.15)
先物取引		
オーストラリア		
(29) SPI 200 Futures March 2019	(18,533)	(0.01)
カナダ		
(304) CAN 10 Years Bond Futures March 2019	(783,826)	(0.25)
ドイツ		
292 Euro-OAT Futures March 2019	(7,739)	(0.00)
香港		
(13) Hang Seng Index Future January 2019	(7,325)	(0.00)
(30) HSCEI Futures January 2019	(1,929)	(0.00)
	(9,254)	(0.00)
シンガポール		
(52) MSCI Taiwan Index January 2019	(44,258)	(0.01)
南アフリカ		
(64) FTSE/JSE Top 40 March 2019	(60,524)	(0.02)
アメリカ		
(209) CBOE VIX Futures January 2019	(982,285)	(0.32)
(255) United States 10 Years Note (CBT) March 2019	(689,203)	(0.22)
18 United States Ultra Bond (CBT) March 2019	(1,938)	(0.00)
	(1,673,426)	(0.54)
先物取引合計		
	(2,597,560)	(0.83)

投資資産明細(続き)

2018年12月31日現在

損益を通じて公正価値で測定する金融資産(続き)

為替先渡契約(注4)**(b)

未収金額	未払金額	償還日	契約数	未実現収益 (米ドル)	純資産総額 比率(%)
AUD700,791	£400,000	03 January 2019	4	(16,129)	(0.01)
AUD7,236,975	£4,100,000	30 January 2019	3	(131,682)	(0.04)
AUD1,519,100	US\$1,098,688	17 January 2019	1	(28,861)	(0.01)
AUD2,123,891	US\$1,533,963	31 January 2019	8	(37,767)	(0.01)
AUD5,300,000	US\$3,880,186	28 February 2019	28	(144,852)	(0.05)
CAD300,000	US\$221,275	03 January 2019	3	(1,607)	(0.00)
CAD58,200,000	US\$44,764,692	09 January 2019	44	(2,142,526)	(0.69)
CAD1,349,000	US\$1,010,741	17 January 2019	1	(22,602)	(0.01)
CHF786,634	€700,000	03 January 2019	5	(2,207)	(0.00)
CHF225,194	€200,000	04 January 2019	1	(180)	(0.00)
CHF1,574,913	€1,400,000	10 January 2019	2	(2,624)	(0.00)
CHF1,100,000	US\$1,121,305	09 January 2019	8	(4,501)	(0.00)
CNY4,000,000	US\$583,272	18 January 2019	4	(1,076)	(0.00)
€100,000	CHF113,267	03 January 2019	1	(588)	(0.00)
€7,400,000	CHF8,435,599	10 January 2019	41	(98,898)	(0.03)
€600,000	£541,351	03 January 2019	5	(3,508)	(0.00)
€5,800,000	£5,238,309	11 January 2019	5	(38,804)	(0.01)
€7,600,000	JPY962,494,400	04 January 2019	1	(85,126)	(0.03)
€8,600,000	JPY1,117,191,807	11 January 2019	10	(352,155)	(0.11)
€400,000	US\$457,692	03 January 2019	3	(319)	(0.00)
€18,200,000	US\$20,848,881	09 January 2019	28	(28,005)	(0.01)
€50,000	AUD90,799	30 January 2019	1	(186)	(0.00)
£19,571,434	€22,300,000	11 January 2019	14	(575,832)	(0.18)
£1,300,000	JPY181,768,340	04 January 2019	1	(1,335)	(0.00)
£100,000	JPY14,147,210	31 January 2019	1	(1,701)	(0.00)
£38,200,000	US\$49,906,989	11 January 2019	124	(1,228,675)	(0.39)
£95,155,987	US\$121,820,623	31 January 2019	2	(438,694)	(0.14)
KRW8,687,686,567	US\$7,823,502	10 January 2019	70	(28,097)	(0.01)
MXN13,500,000	US\$686,324	09 January 2019	9	(1,651)	(0.00)
NOK33,500,000	US\$4,018,446	30 January 2019	13	(144,241)	(0.05)
NZD3,800,000	US\$2,552,870	03 January 2019	1	(4,618)	(0.00)
NZD3,100,000	US\$2,144,765	28 February 2019	25	(63,859)	(0.02)
SEK5,000,000	US\$566,399	18 January 2019	5	(1,586)	(0.00)
US\$70,302	AUD100,000	03 January 2019	1	(102)	(0.00)
US\$7,900,225	CHF7,800,000	09 January 2019	16	(18,925)	(0.01)
US\$15,987	CHF15,727	31 January 2019	1	(13)	(0.00)
US\$1,584,614	CNY11,000,000	18 January 2019	6	(16,426)	(0.01)
US\$341,078	€300,000	03 January 2019	1	(1,951)	(0.00)
US\$2,164,118	€1,900,000	09 January 2019	4	(9,490)	(0.00)
US\$4,829,944	€4,247,417	17 January 2019	2	(32,506)	(0.01)
US\$715,419	€625,574	31 January 2019	3	(1,614)	(0.00)
US\$563,423	£450,000	11 January 2019	1	(10,013)	(0.00)
US\$98,823	£77,992	17 January 2019	1	(593)	(0.00)
US\$2,006,105	£1,582,362	31 January 2019	2	(12,372)	(0.00)
US\$435,533	JPY48,900,000	04 January 2019	2	(10,332)	(0.00)
US\$27,103,071	JPY3,040,000,000	11 January 2019	15	(631,296)	(0.20)
US\$227,406	JPY25,190,285	17 January 2019	2	(2,512)	(0.00)
US\$31,304,986	JPY3,514,735,305	31 January 2019	7	(808,803)	(0.27)
US\$13,007,554	KRW14,600,000,000	10 January 2019	67	(92,932)	(0.03)
US\$1,170,564	KRW1,309,569,000	17 January 2019	1	(4,842)	(0.00)
US\$6,812,771	MXN140,500,000	09 January 2019	13	(312,894)	(0.10)
US\$536,146	NZD800,000	03 January 2019	7	(329)	(0.00)
US\$67,003	NZD100,000	04 January 2019	1	(58)	(0.00)
US\$16,252,210	SEK145,500,000	18 January 2019	23	(183,843)	(0.06)
US\$6	SEK57	31 January 2019	1	-	(0.00)
US\$2,772,407	SGD3,800,000	25 January 2019	1	(17,093)	(0.01)

為替先渡取引に係わる未実現損失の合計

(7,803,431) (2.50)

損益を通じて公正価値で評価される金融負債の合計(売買目的)

(10,872,840) (3.48)

損益を通じて公正価値で評価される金融資産の合計(売買目的)

273,306,640 87.59

損益を通じて公正価値で評価される金融負債の合計(売買目的)

(10,872,840) (3.48)

その他資産

49,606,993 15.89

買戻し可能参加型株式の保有者に帰属する純資産総額

312,040,793 100.00

** 為替先渡取引は、バンク・オブ・ニューヨーク・メロン、ドイツ銀行AG、HSBC銀行Plc（ロンドン）、ロイヤルバンク・オブ・スコットランドで保管されている。

分類：

- (a) 上場デリバティブ商品
 (b) 店頭取引（OTC）金融デリバティブ商品

規制を受けている別の市場で取引されている譲渡可能証券

#公式な証券取引所に上場している、または規制を受けている別の市場で取引されている譲渡可能証券以外の譲渡可能証券

会計年度末時点で保有されている全てのその他有価証券は、公式な証券取引所に上場している譲渡可能証券である。

	% of Total
資産総額の分析	Assets
公式な証券取引所に上場している譲渡可能証券	63.21
上記の分類(a)に記載されている上場金融デリバティブ商品	1.03
上記の分類(b)に記載されている店頭取引（OTC）金融デリバティブ商品	9.48
上記の#に記載されている譲渡可能証券	4.25
その他流動資産	22.03
	<hr/>
	100.00

UCITS通知8.2付属資料Bの下では、純資産総額ではなく資産総額の分析が要求されている。

楽天・国内マネー・マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成30年11月20日現在 金額（円）	令和元年5月20日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,179,873,778	890,766,768
現先取引勘定	499,999,838	1,500,229,558
流動資産合計	1,679,873,616	2,390,996,326
資産合計	1,679,873,616	2,390,996,326
負債の部		
流動負債		
未払解約金	122,360,000	28,695,000
その他未払費用	11,501	-
流動負債合計	122,371,501	28,695,000
負債合計	122,371,501	28,695,000
純資産の部		
元本等		
元本	1,555,262,684	2,359,811,685
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,239,431	2,489,641
元本等合計	1,557,502,115	2,362,301,326
純資産合計	1,557,502,115	2,362,301,326
負債純資産合計	1,679,873,616	2,390,996,326

（注）親投資信託の計算期間は、原則として毎年6月16日から翌年6月15日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>1. 現先取引 現先取引の会計処理については、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成20年3月10日）の規定によっております。</p> <p>2. 金融商品の時価に関する補足情報 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>
-------------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年11月20日現在	令和元年5月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,555,262,684口	2,359,811,685口
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の1口当たり純資産額（1万口当たり純資産額）	1.0014円 (10,014円)	1.0011円 (10,011円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年11月20日現在	令和元年5月20日現在
1. 貸借対照表計上額と時価との差額	貸借対照表計上額は原則として時価で計上されているため、差額はありません。	貸借対照表計上額は原則として時価で計上されているため、差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 該当事項はありません。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 該当事項はありません。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

平成30年11月20日現在	令和元年5月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	自 平成30年 1月19日 至 平成30年11月20日	自 平成30年11月21日 至 令和元年 5月20日
1. 元本の推移 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	2,599,640,503円	1,555,262,684円
同期中における追加設定元本額	26,362,938,408円	5,060,684,811円
同期中における一部解約元本額	27,407,316,227円	4,256,135,810円
2. 同計算期末における元本の内訳 ファンド名		
楽天ブルベア・マネープール	1,550,757,623円	2,355,296,636円
楽天USリート・トリプルエン ジン・プラス（リアル）毎月分 配型	2,492,274円	2,492,274円
新ホリコ・フォーカス・ファン ド	996,910円	996,910円
楽天グローバル・プレミア・ ファンド（ロボット自動運用 型）	997,905円	997,905円
楽天グローバル中小型バリュー 株ファンド	8,986円	8,986円
楽天・スタイル・リスク・プレ ミア戦略ファンド	8,986円	8,986円
楽天・全世界債券インデックス （為替ヘッジ）ファンド	-円	9,988円
計	1,555,262,684円	2,359,811,685円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

<更新後>

「楽天グローバル・プレミア・ファンド（ロボット自動運用型）」

（2019年6月28日現在）

項目	金額または口数
資産総額	763,352,078円
負債総額	1,091,960円
純資産総額（ - ）	762,260,118円
発行済数量	834,648,762口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9133円

（参考情報）「楽天・国内マネー・マザーファンド」

（2019年6月28日現在）

項目	金額または口数
資産総額	2,337,013,076円
負債総額	33,776,000円
純資産総額（ - ）	2,303,237,076円
発行済数量	2,301,002,960口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0010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30年12月末日現在）

（後略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（2019年6月末日現在）

（後略）

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務の一部および投資助言・代理業務を行っています。

平成30年12月末日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。

種 類	本 数	純資産総額
追加型株式投資信託	44本	163,602百万円
合 計	44本	163,602百万円

<訂正後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務の一部および投資助言・代理業務を行っています。

2019年6月末日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。

種 類	本 数	純資産総額
追加型株式投資信託	45本	194,402百万円
合 計	45本	194,402百万円

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 委託会社である楽天投信投資顧問株式会社（以下「当社」といいます。）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」といいます。）、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8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 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13期事業年度（平成30年4月1日から平成30年12月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日現在)		当事業年度 (平成30年12月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		670,928		749,355
金銭の信託		1,300,000		1,300,000
前払費用		2,915		6,087
未収委託者報酬		173,836		118,904
立替金		-		12,980
その他		5,000		5,000
流動資産計		2,152,681		2,192,328
固定資産				
有形固定資産	1	36,926	1	34,138
建物（純額）		23,218		20,816
器具備品（純額）		13,707		13,321
無形固定資産		-		19,448
ソフトウェア		-		19,448
投資その他の資産		24,109		51,609
投資有価証券		14,291		39,373
長期前払費用		644		405
繰延税金資産		9,172		11,830
固定資産計		61,035		105,195
資産合計		2,213,716		2,297,524

（単位：千円）

	前事業年度 (平成30年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	3,131	5,949
未払費用	94,055	86,606
未払消費税等	9,375	11,091
未払法人税等	32,716	6,212
賞与引当金	14,916	12,138
役員賞与引当金	8,000	3,195
流動負債計	162,194	125,191
固定負債		
退職給付引当金	-	3,366
資産除去債務	5,699	5,699
固定負債計	5,699	9,065
負債合計	167,894	134,257
純資産の部		
株主資本		
資本金	150,000	150,000
資本剰余金		
資本準備金	400,000	400,000
その他資本剰余金	229,716	229,716
資本剰余金合計	629,716	629,716
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	1,266,597	1,385,144
利益剰余金合計	1,266,597	1,385,144
株主資本合計	2,046,314	2,164,860
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	491	1,593
評価・換算差額合計	491	1,593
純資産合計	2,045,822	2,163,266
負債・純資産合計	2,213,716	2,297,524

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	前事業年度 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）	当事業年度 （自平成30年4月1日 至平成30年12月31日）
営業収益		
委託者報酬	1,216,403	924,875
営業収益計	1,216,403	924,875
営業費用		
支払手数料	491,228	339,622
委託費	-	4,355
広告宣伝費	7,342	3,867
通信費	65,818	61,259
協会費	1,766	1,286
諸会費	18	36
営業費用計	566,173	410,425
一般管理費	1・2	1・2
	364,433	353,691
営業利益	285,796	160,758
営業外収益		
受取利息	6	3
有価証券利息	683	231
投資有価証券売却益	837	-
為替差益	8	-
雑収入	-	41
営業外収益計	1,535	276
営業外費用		
投資有価証券売却損	-	671
為替差損	-	128
営業外費用計	-	800
経常利益	287,332	160,234
特別損失		
その他特別損失	10,492	72
特別損失計	10,492	72
税引前当期純利益	276,840	160,161
法人税、住民税及び事業税	80,331	43,786
法人税等調整額	670	2,171
法人税等合計	81,002	41,615
当期純利益	195,837	118,546

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	150,000	400,000	229,716	629,716
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				
当期変動額合計	-	-	-	-
当期末残高	150,000	400,000	229,716	629,716

	株主資本			評価・換算差額等		純資産合計
	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	
	その他利益剰余金	利益剰余金				
	繰越利益剰余金	合計				
当期首残高	1,220,760	1,220,760	2,000,476	244	244	2,000,720
当期変動額						
剰余金の配当	150,000	150,000	150,000			150,000
当期純利益	195,837	195,837	195,837			195,837
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				735	735	735
当期変動額合計	45,837	45,837	45,837	735	735	45,102
当期末残高	1,266,597	1,266,597	2,046,314	491	491	2,045,822

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	150,000	400,000	229,716	629,716
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				
当期変動額合計	-	-	-	-
当期末残高	150,000	400,000	229,716	629,716

	株主資本			評価・換算差額等		純資産合計
	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	
	その他利益剰余金	利益剰余金				
	繰越利益剰余金	合計				
当期首残高	1,266,597	1,266,597	2,046,314	491	491	2,045,822
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益	118,546	118,546	118,546			118,546
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				1,102	1,102	1,102
当期変動額合計	118,546	118,546	118,546	1,102	1,102	117,444
当期末残高	1,385,144	1,385,144	2,164,860	1,593	1,593	2,163,266

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

当事業年度末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) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、以下の通りであります。

建物 10年

器具備品 5～20年

また、取得価額が100千円以上200千円未満の減価償却資産につきましては、3年均等償却によっております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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）に基づいております。

(3) 長期前払費用

定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒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、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上することとしております。

(2) 賞与引当金

従業員への賞与の支払いに備えるため、従業員に対する賞与の支給見込額のうち、当事業年度に帰属する額を計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員への賞与の支払いに備えるため、役員に対する将来の支給見込額のうち、当事業年度末において負担すべき額を計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度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。

数理計算上の差異の費用処理方法

数理計算上の差異については、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。

4. その他財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理方法

消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

（表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」9,060千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」9,172千円に含めて表示しております。

（追加情報）

当社は、平成30年6月27日開催の定時株主総会で「定款一部変更の件」が承認されたことを受けまして、決算期を3月31日から12月31日に変更いたしました。したがって第13期事業年度は平成30年4月1日から平成30年12月31日までとなっております。

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産より控除した減価償却累計額

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成30年12月31日)
有形固定資産より控除した減価償却計額	18,684千円	23,495千円

（損益計算書関係）

1. 役員報酬の範囲

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日)
取締役 年額	200,000千円	200,000千円
監査役 年額	30,000千円	30,000千円

2. 一般管理費の主なもののうち主要な費目及び金額は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日)
人件費	208,027千円	212,003千円
減価償却費	8,196千円	6,321千円
賞与引当金繰入額	14,916千円	12,138千円
役員賞与引当金繰入額	8,000千円	3,195千円
退職給付費用	-	3,366千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	13,000株	-	-	13,000株

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成29年6月29日 定時株主総会	普通株式	150	11,538.46	平成29年3月31日	平成29年6月29日

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	13,000株	-	-	13,000株

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

該当事項はありません。

（リース取引関係）

<借主側>

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

	前事業年度 平成30年3月31日	当事業年度 平成30年12月31日
1年内	-	16,800千円
1年超	-	64,400千円
合計	-	81,200千円

（金融商品関係）

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

当社は、投資信託の運用を業として行っております。

当社では保有する金融資産・負債から生ずる様々なリスクを横断的かつ効率的に管理し、財務の健全性の維持を図っております。

なお、余資運用に関しては、預金等安全性の高い金融資産で運用しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

現金・預金は、国内通貨による預金等であり、短期間で決済されるため、為替変動リスクや価格変動リスクは殆どないと認識しております。金銭の信託は、主に債権等を裏付けとした証券化商品を運用対象としておりますが、保有している証券化商品の外部格付機関による格付評価が高いため、価格変動リスクは殆どないと認識しております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクは殆ど無いと認識しております。

投資有価証券は当社運用投資信託であり、当初自己設定および商品性維持を目的に保有しております。当該投資信託は為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、投資金額はその目的に応じた額にとどめられており、リスクは極めて限定的であると認識しています。

未払費用につきましては、そのほとんどが一年以内で決済されます。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
資産			
(1) 現金・預金	670,928	670,928	-
(2) 金銭の信託	1,300,000	1,300,000	-
(3) 未収委託者報酬	173,836	173,836	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	14,291	14,291	-
資産計	2,159,056	2,159,056	-
負債			
(1) 未払費用	94,055	94,055	-
(2) 未払法人税等	32,716	32,716	-
負債計	126,771	126,771	-

当事業年度（平成30年12月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
資産			
(1) 現金・預金	749,355	749,355	-
(2) 金銭の信託	1,300,000	1,300,000	-
(3) 未収委託者報酬	118,904	118,904	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	39,373	39,373	-
資産計	2,207,633	2,207,633	-
負債			
(1) 未払費用	86,606	86,606	-
(2) 未払法人税等	6,212	6,212	-
負債計	92,818	92,818	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1)現金・預金 (2)金銭の信託 (3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と類似していることから、当該帳簿価額によっております。

(4)投資有価証券

投資信託は公表されている基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

(1)未払費用 (2)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と類似していることから、当該帳簿価額によっております。

2. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内
現金・預金	670,928	-
金銭の信託	1,300,000	-
未収委託者報酬	173,836	-
投資有価証券		
その他有価証券のうち満期があるもの	-	-
合 計	2,144,764	-

当事業年度（平成30年12月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内
現金・預金	749,355	-
金銭の信託	1,300,000	-
未収委託者報酬	118,904	-
投資有価証券		
その他有価証券のうち満期があるもの	-	-
合 計	2,168,259	-

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成30年3月31日）

区分	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	14,291	15,000	708
小計	14,291	15,000	708
合計	14,291	15,000	708

当事業年度（平成30年12月31日）

区分	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	39,373	41,671	2,297
小計	39,373	41,671	2,297
合計	39,373	41,671	2,297

2. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	13,837	837	-
合計	13,837	837	-

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	9,328	-	671
合計	9,328	-	671

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を利用していないため、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概略

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日)
退職給付債務の期首残高	-	-
勤務費用	-	3,366千円
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	-	95千円
退職給付の支払額	-	-
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	-	3,461千円

（2）退職給付債務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

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日)
非積立制度の退職給付債務	-	3,461千円
未積立退職給付債務	-	3,461千円
未認識数理計算上の差異	-	95千円
未認識過去勤務費用	-	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	3,366千円
退職給付引当金	-	3,366千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	3,366千円

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日)
勤務費用	-	3,366千円
利息費用	-	-
期待運用収益	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	-	-
過去勤務費用の費用処理額	-	-
確定給付制度に係る退職給付費用	-	3,366千円

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成30年12月31日)
割引率	-	0.6%
長期期待運用収益率	-	-
予想昇給率	-	2.3%

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成30年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	1,765千円	4,956千円
未払事業所税	214千円	201千円
未払事業税	2,512千円	1,083千円
賞与引当金	4,567千円	3,716千円
退職給付引当金	-	1,030千円
減価償却超過額	852千円	1,084千円
繰延資産	308千円	187千円
資産除去債務	1,745千円	1,745千円
その他有価証券評価差額金	216千円	703千円
その他	6,576千円	6,946千円
繰延税金資産小計	18,760千円	21,657千円
評価性引当金	8,322千円	8,692千円
繰延税金資産合計	10,438千円	12,964千円
繰延税金負債		
建物付属設備	1,265千円	1,134千円
繰延税金負債合計	1,265千円	1,134千円
繰延税金資産純額	9,172千円	11,830千円

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

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成30年12月31日)
法定実効税率	30.86%	30.62%
（調整）		
所得拡大税制の特別控除	2.39%	4.89%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.59%	0.64%
住民税均等割等	0.10%	0.14%
評価性引当額の増減	0.88%	0.23%
その他	1.00%	0.75%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.26%	25.98%

（資産除去債務関係）

1．当該資産除去債務の概要

建物賃貸借契約に基づき使用する建物等の、退去時における原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を10年と見積り、割引率を0%として資産除去債務の金額を計算しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

	前事業年度 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）	当事業年度 （自平成30年4月1日 至平成30年12月31日）
期首残高	5,699千円	5,699千円
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	-	-
見積りの変更による増加額	-	-
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	5,699千円	5,699千円

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）及び当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日）

当社は、投資運用業、投資助言・代理業を主とした金融サービスの提供を行う単一セグメントであるため、記載を省略しております。

〔関連情報〕

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託運用業務	投資一任業務	情報提供業務	合計
外部顧客への営業収益	1,216,403	-	-	1,216,403

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載は省略しております。

(2) 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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日）

1 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託運用業務	投資一任業務	情報提供業務	合計
外部顧客への営業収益	924,875	-	-	924,875

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載は省略しております。

(2) 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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
兄弟会社	楽天証券株式会社	東京都世田谷区	7,495 (平成30年3月31日現在)	インターネット証券取引サービス業		兼任 2人	当社投資信託の募集の取扱い等	証券投資信託の代行手数料等 出向者の人件費等	225,276 16,083	未払費用	22,288

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成30年12月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
兄弟会社	楽天証券株式会社	東京都世田谷区	7,495 (平成30年12月31日現在)	インターネット証券取引サービス業		兼任 2人	当社投資信託の募集の取扱い等	証券投資信託の代行手数料等 出向者の人件費等	151,731 18,126	未払費用	25,055

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 証券投資信託の代行手数料については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

楽天株式会社（東京証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）	当事業年度 （自平成30年4月1日 至平成30年12月31日）
1株当たり純資産額	157,370円98銭	166,405円14銭
1株当たり当期純利益金額	15,064円45銭	9,118円97銭

- （注）1．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項 目	前事業年度 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）	当事業年度 （自平成30年4月1日 至平成30年12月31日）
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益金額（千円）	195,837	118,546
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	195,837	118,546
普通株式の期中平均株式数（株）	13,000.00	13,000.00

（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

名称	資本金の額 (平成30年12月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス 信託銀行株式会社)	三井住友信託銀行 342,037百万円 (日本トラスティ・ サービス信託銀行 51,000百万円)	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(兼 営法)に基づき信託業務を営 んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
 設立年月日 : 平成12年6月20日
 業務の概要 : 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に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成30年12月末日現在)	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SBI証券	48,323百万円	

<訂正後>

(1) 受託会社

名称	資本金の額 (2019年6月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス 信託銀行株式会社)	三井住友信託銀行 342,037百万円 (日本トラスティ・ サービス信託銀行 51,000百万円)	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(兼 営法)に基づき信託業務を営 んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
 設立年月日 : 2000年6月20日
 業務の概要 : 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に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2019年6月末日現在)	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SBI証券	48,323百万円	

独立監査人の中間監査報告書

令和元年7月12日

楽天投信投資顧問株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛 印
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」に掲げられている楽天グローバル・プレミア・ファンド（ロボット自動運用型）の平成30年11月21日から令和元年5月20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、楽天グローバル・プレミア・ファンド（ロボット自動運用型）の令和元年5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中間計算期間（平成30年11月21日から令和元年5月20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

楽天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

-
- () 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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成31年2月20日

楽天投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛 印
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」に掲げられている楽天投信投資顧問株式会社の平成30年4月1日から平成30年12月31日までの第13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、楽天投信投資顧問株式会社の平成30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

- () 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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。