

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成30年8月15日提出

【発行者名】 NNインベストメント・パートナーズ株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役 木村弘志

【本店の所在の場所】 東京都千代田区紀尾井町4番1号
ニューオータニガーデンコート

【事務連絡者氏名】 高橋英則

【電話番号】 03 - 5210 - 0646

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券 NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース(毎月
に係るファンドの名称】 分配型)

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券 継続募集額500億円を上限とします。
の金額】

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成30年8月15日に有価証券報告書を提出しました。これに伴い、平成30年2月15日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」および「第三部 委託会社等の情報」に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。

2【訂正の内容】

原届出書について、それぞれ下記事項と同一内容に原届出書を訂正します。下線部_____は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

(4)【発行(売出)価格】

(略)

< 訂正前 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (9:00 ~ 17:00土、日、祝日、年末年始を除く)

< 訂正後 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (営業日の9:00 ~ 17:00)

(5)【申込手数料】

(略)

< 訂正前 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (9:00 ~ 17:00土、日、祝日、年末年始を除く)

< 訂正後 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (営業日の9:00 ~ 17:00)

(6)【申込単位】

(略)

< 訂正前 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (9:00 ~ 17:00土、日、祝日、年末年始を除く)

< 訂正後 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (営業日の9:00 ~ 17:00)

(8)【申込取扱場所】

(略)

< 訂正前 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (9:00 ~ 17:00土、日、祝日、年末年始を除く)

< 訂正後 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (営業日の9:00 ~ 17:00)

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】

(略)

<ファンドの特色>（下記の内容に訂正します。）

下記の「ファンドの特色」には、当ファンドと実質的な投資対象資産（米ドル建てのハイ・イールド債券）が同じで、為替戦略の異なるファンドの情報を合わせて説明している部分があります。

1. 日本を除くアジアの企業が発行する主に米ドル建てのハイ・イールド債券を実質的な主要投資対象とします。

- ケイマン籍の「NNケイマン・ファンズII-NN(C)アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」への投資を通じて、アジアの企業が発行するハイ・イールド債券に投資します。
- 米ドル建て以外のハイ・イールド債券に投資することがあります。その場合、原則として対米ドルで為替ヘッジを行います。
- ファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。

2. 主要投資対象とする投資信託証券の運用は、アジア債券の運用で実績のあるNNインベストメント・パートナーズ・シンガポール・リミテッドが行います。

3. 日本円コース(毎月分配型)と米ドルコース(毎月分配型)の2本からお選びいただけます。

日本円コース(毎月分配型) 対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

米ドルコース(毎月分配型) 対円で為替ヘッジを行わないため、為替変動の影響を受けます。

4. 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い分配を行います。

- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないこともあります。

(注)資金動向や市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

アジア・ハイ・イールド債券について

ハイ・イールド債券とは？

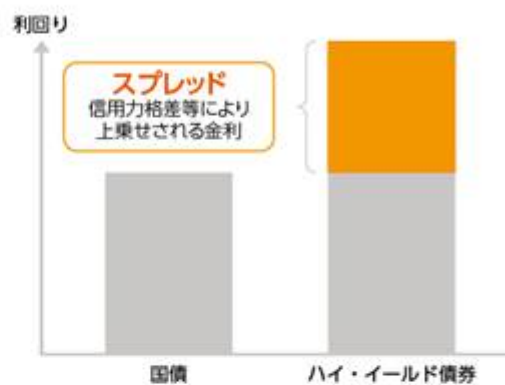
- ハイ・イールド債券とは、一般的に格付機関によって付与される信用力を示す格付がBB/Ba格以下の高利回り債券を指します。
- 投資適格債に比べ、信用力が低く債務不履行（デフォルト）に陥るリスクが高い反面、利回りが高いという特徴があります。

債券格付と信用力・利回りの関係

	S&P	ムーディーズ	信用力	利回り
投資適格債	AAA	Aaa	高い	低い
	AA	Aa		
	A	A		
	BBB	Baa		
ハイ・イールド債 (投機的格付債)	BB	Ba	低い	高い
	B	B		
	CCC	Caa		
	CC	Ca		
	C	C		

※イメージ図であり、必ずしもすべての場合に当てはまるわけではありません。

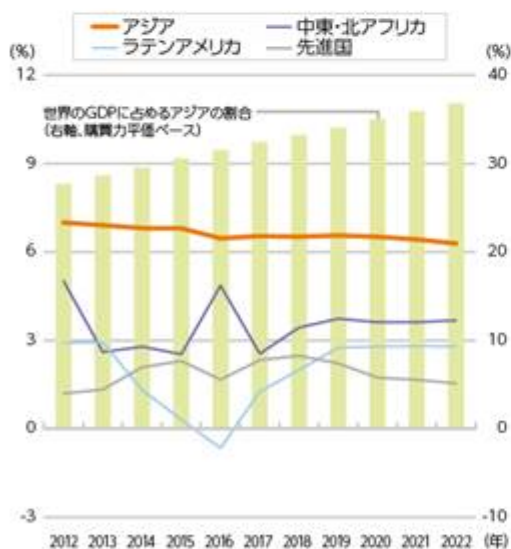
ハイ・イールド債券の利回りイメージ



1 アジアの経済成長力

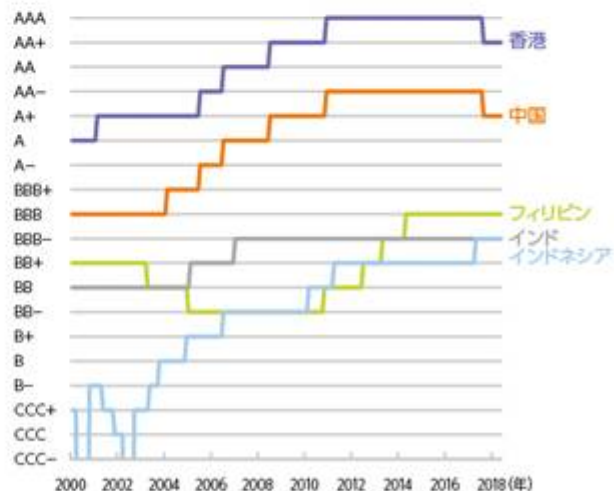
- 中国の経済成長の減速を受けて、経済成長率が鈍化傾向にあるアジア地域ですが、成長力は先進国や他の新興地域を上回っており、アジア地域のGDPが世界全体に占める割合は今後も拡大する見込みです。
- 経済成長に伴い信用力も長期的には改善傾向にあり、アジア地域の投資環境を支えています。

地域別実質GDP成長率等
(2012年～2022年)



※折れ線グラフは各地域の実質GDP成長率(左軸)
※上記はIMFによる予測値も含まれます。

アジア各国・地域の
外貨建て長期債務格付けの推移(S&P)
(2000年1月末～2018年6月末)



※上記はJPMorgan Asia Credit Index -Corporate High Yield
の組入れ上位5カ国を対象にしています。

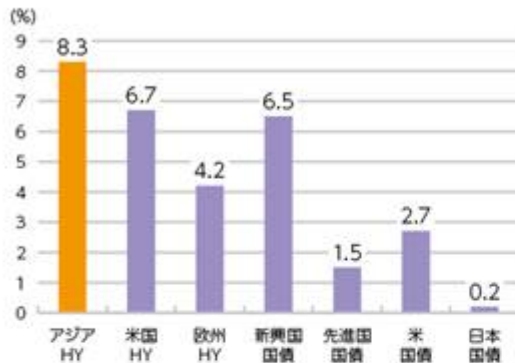
出所：IMF, World Economic Outlook Database, April 2018, BloombergのデータをもとにNNインベストメント・パートナーズ株式会社が作成

上記データは過去のものであり、将来の運用成果または投資収益を示唆あるいは保証するものではありません。

2 相対的に高い利回り

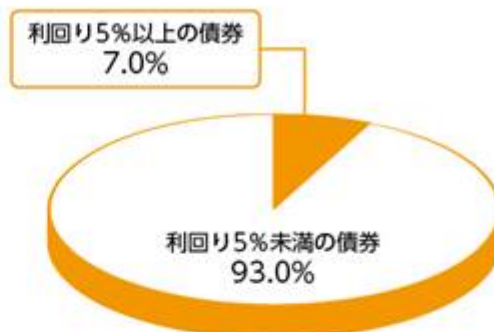
- アジア・ハイ・イールド債券は他の債券と比較して、信用力は低いものの、相対的に利回りが高い傾向があります。
- 世界的な低金利の環境下、世界の債券市場で5%以上の利回りを持つ債券はわずか7.0%にとどまっています。

債券の利回り比較
(2018年6月末現在)



※HY=ハイ・イールド債券

世界債券市場の利回り水準別残高構成比
(2018年6月末現在)



※利回り水準は最終利回りを基準にしています。

3 相対的に良好なパフォーマンス

- アジア・ハイ・イールド債券はリーマンショックや欧州債務危機などの大きなリスクイベントの際には、価格変動が大きくなりましたが、中長期的には他の債券と比較して概ね良好に推移してきました。

債券のパフォーマンス比較
(2005年12月末～2018年6月末)



アジアHY=JPMorgan Asia Credit Index-Corporate High Yield, 米国HY=ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index, 欧州HY=ICE BofA Merrill Lynch European Currency High Yield Constrained Index, 新興国国債=JPMorgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified, 先進国国債=FTSE世界国債インデックス, 米国債, 日本国債=FTSE世界国債インデックスの国別インデックス, 世界債券市場=ブルームバーグ・パークレイズ・マルチバース・インデックス(欧州HY, 先進国国債, 日本国債は現地通貨ベース, それ以外は米ドルベース)

出所: Bloomberg, JPモルガン・マーケッツ, パークレイズのデータをもとにNNインベストメント・パートナーズ株式会社が作成

【本資料で使用している指数について】JPMorgan Asia Credit Index, JPMorgan Emerging Markets Bond Index Global Diversifiedに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index, ICE BofA Merrill Lynch European Currency High Yield Constrained Indexに関する著作権・知的財産権その他一切の権利はICE BofA Merrill Lynchに帰属します。FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発、算出、および公表されている債券インデックスです。ブルームバーグ・インデックス・サービス・リミテッド(以下「BISL」)は、ブルームバーグLP、(以下、ブルームバーグLPとその関連会社を総称して「ブルームバーグ」)の完全子会社です。BISLはブルームバーグ・パークレイズ・インデックス(以下「インデックス」)の独占的な管理者として、パークレイズ・バンクPLCおよびその関連会社(「パークレイズ」)から独立して営業しています。ブルームバーグは、ライセンスに基づいて使用されるパークレイズの高標を除き、インデックスに関連するすべての知的財産を所有しています。

上記データは過去のものであり、将来の運用成果または投資収益を示唆あるいは保証するものではありません。

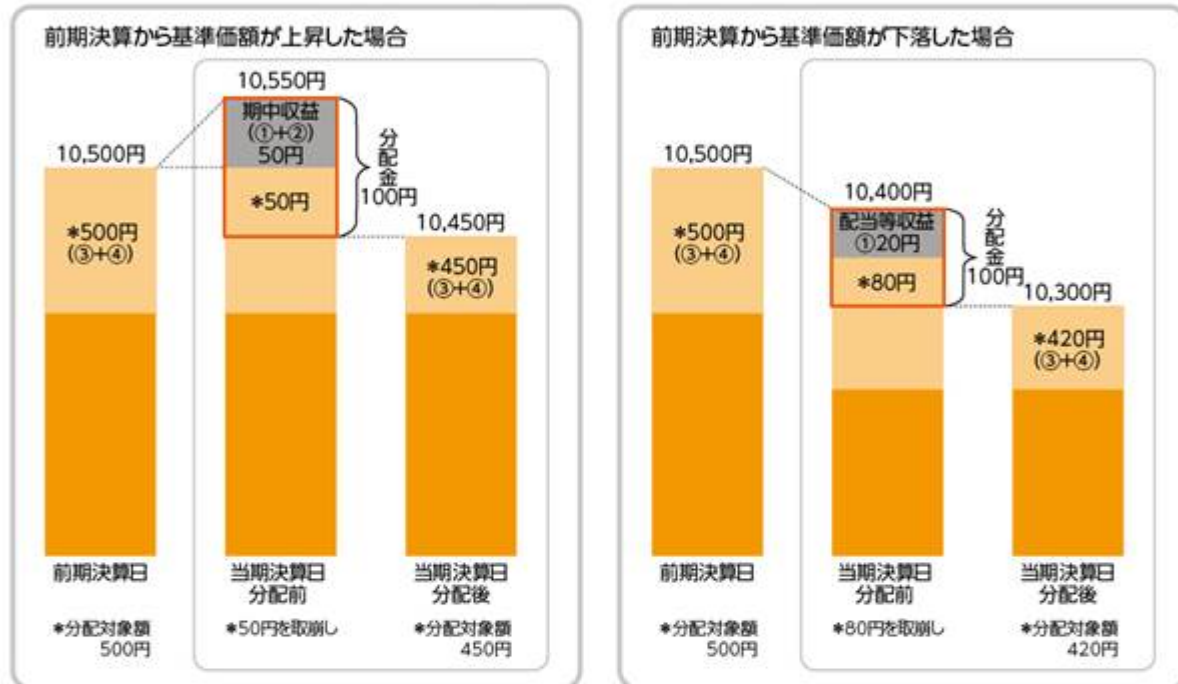
収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。

分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部またはすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。

また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

普通金分配：個別元本(受益者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の受益者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。(特別分配金)

(注) 普通分配金に対する課税については、「手続・手数料等」の「税金」をご参照ください。

< 投資対象とする投資信託証券の概要 >

(略)

< 訂正前 >

運用管理費用等	純資産総額に対して年率0.3% ただし、 <u>監査費用やファンドの設立費用等</u> 、ファンド運営に関する費用が別途かかります。
---------	---

< 訂正後 >

運用報酬	純資産総額に対して年率0.3% ただし、 <u>監査費用等</u> 、ファンド運営に関する費用が別途かかります。
------	---

3【投資リスク】

(略)

< 訂正前 >

カントリーリスク

一般に債券等への投資は、その国の政治・経済動向、通貨規制、資本規制、税制等の要因によって影響を受けます。そのため、投資対象有価証券の発行国・地域の政治、経済、社会情勢等の変化により、金融・資本市場が混乱し、資産価値が大きく変動することがあります。

< 訂正後 >

カントリーリスク

一般に債券等への投資は、その国の政治・経済動向、通貨規制、資本規制、税制等の要因によって影響を受けます。そのため、投資対象債券等の発行国・地域の政治、経済、社会情勢等の変化により、金融・資本市場が混乱し、資産価値が大きく変動することがあります。

参考情報(下記の内容に訂正します。)

NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース(毎月分配型)

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



左グラフは2013年7月から2018年6月の各月末におけるファンドの直近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。
右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、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。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したとみなして計算しており、実際の基準価額とは異なります。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。ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。右グラフは、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あり、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。

資産クラス	指数名称	権利者
日本株	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCI-KOKUSAI(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	野村證券株式会社
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	FTSE Fixed Income LLC
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

※騰落率は、各権利者が提供する指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。

海外の指数は、対円での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。

各指数に関する著作権等の知的財産権、その他一切の権利は、上記に記載の各権利者に帰属します。また、株式会社野村総合研究所および各指数の権利者は、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行わないほか、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

<各資産クラスの指数について>

TOPIX(東証株価指数)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(以下(株)東京証券取引所)の知的財産であり、当指数の算出、指数値の公表、利用に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、当指数の算出もしくは公表の方法の変更、算出もしくは公表の停止、また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 KOKUSAI(配当込み、円ベース)およびMSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース))に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA BPI(国債)に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより開発、算出、および公表されている債券インデックスです。

JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、JP.Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

(略)

< 訂正前 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (9:00 ~ 17:00土、日、祝日、年末年始を除く)

< 訂正後 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (営業日の9:00 ~ 17:00)

(4)【その他の手数料等】

(略)

< 訂正前 >

ファンドが投資対象とする投資信託証券における組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、ファンドの設立にかかる費用、現地での登録費用、法律顧問費用、資産を外国に保管する場合の費用、租税、監査費用、借入金や立替金に関する利息等は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

< 訂正後 >

ファンドが投資対象とする投資信託証券における組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、現地での登録費用、法律顧問費用、資産を外国に保管する場合の費用、租税、監査費用、借入金や立替金に関する利息等は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(5)【課税上の取扱い】

(略)

< 訂正前 >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象です。NISA(ニーサ)をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

< 訂正後 >

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

5【運用状況】（下記の内容に訂正します。）

(1)【投資状況】

（平成30年 6月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	600,154,218	98.8
親投資信託受益証券	日本	1,403,503	0.2
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	5,888,453	1.0
合計(純資産総額)		607,446,174	100.0

注：投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

[参考]NN短期債券マザーファンドの投資状況

（平成30年 6月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	日本	702,127,810	26.7
特殊債券	日本	400,430,096	15.3
社債券	日本	1,242,680,825	47.3
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	280,361,316	10.7
合計(純資産総額)		2,625,600,047	100.0

注：投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】(平成30年6月29日現在)

イ)主要投資銘柄

銘柄	業種	数量 口	簿価 単価 円	簿価金額 円	評価 単価 円	評価金額 円	投資比 率 (%)
NNケイマン・ファンズ (C)アジア・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド 米ドルクラ ス	-	451,583,310	1.34	607,226,718	1.32	600,154,218	98.8
NN短期債券マザーファンド	-	1,339,221	1.0481	1,403,637	1.0480	1,403,503	0.2

注: 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価額の比率です。

ロ)種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.8
親投資信託受益証券	0.2
合計	99.0

【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。

〔参考〕NN短期債券マザーファンドの投資状況

投資有価証券の主要銘柄（平成30年6月29日現在）

イ) 主要投資銘柄（全23銘柄）

種類	国名	銘柄名	利率 (%)	償還期限	額面	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	社債券	日本	第22回国際協力機構債券	0.260	2018/12/20	135,500,000	100.12	135,671,735	100.12	135,671,735	5.2
2	社債券	日本	第11回東日本旅客鉄道株式会社社債（一般担保付）	2.970	2019/2/25	100,000,000	101.92	101,926,009	101.92	101,926,009	3.9
3	社債券	日本	第40回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.557	2019/1/29	100,000,000	100.89	100,899,796	100.89	100,899,796	3.8
4	社債券	日本	第18回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	1.719	2018/12/20	100,000,000	100.79	100,799,256	100.79	100,799,256	3.8
5	社債券	日本	第18回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.700	2018/12/11	100,000,000	100.75	100,758,678	100.75	100,758,678	3.8
6	社債券	日本	第24回都市再生債券	1.910	2018/11/22	100,000,000	100.74	100,746,925	100.74	100,746,925	3.8
7	地方債証券	日本	平成20年度第1回栃木県公募債	1.730	2018/11/28	100,000,000	100.70	100,707,232	100.70	100,707,232	3.8
8	社債券	日本	第469回関西電力株式会社社債（一般担保付）	1.700	2018/10/25	100,000,000	100.54	100,546,719	100.54	100,546,719	3.8
9	地方債証券	日本	平成20年度第1回山梨県公募債（10年）	1.550	2018/10/30	100,000,000	100.51	100,511,095	100.51	100,511,095	3.8
10	社債券	日本	第21回一般担保住宅金融支援機構債券	1.920	2018/9/20	100,000,000	100.42	100,429,970	100.42	100,429,970	3.8
11	地方債証券	日本	平成20年度第7回北海道公募債	1.720	2018/9/25	100,000,000	100.40	100,408,197	100.40	100,408,197	3.8
12	社債券	日本	第357回中国電力株式会社社債（一般担保付）	1.658	2018/9/25	100,000,000	100.39	100,396,594	100.39	100,396,594	3.8
13	社債券	日本	第17回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.720	2018/9/20	100,000,000	100.39	100,390,130	100.39	100,390,130	3.8
14	地方債証券	日本	第662回東京都公募債	1.670	2018/9/20	100,000,000	100.37	100,379,846	100.37	100,379,846	3.8
15	特殊債券	日本	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	1.600	2018/8/20	100,000,000	100.22	100,221,688	100.22	100,221,688	3.8
16	特殊債券	日本	第762号農林債	0.300	2018/11/27	100,000,000	100.12	100,123,464	100.12	100,123,464	3.8
17	社債券	日本	第51回中日本高速道路株式会社社債	0.320	2018/11/8	100,000,000	100.11	100,113,278	100.11	100,113,278	3.8
18	地方債証券	日本	第99回大阪府公募債（5年）	0.240	2018/10/30	100,000,000	100.08	100,084,889	100.08	100,084,889	3.8
19	特殊債券	日本	第285回信金中金債（5年）	0.350	2018/8/27	100,000,000	100.05	100,055,805	100.05	100,055,805	3.8
20	特殊債券	日本	第758号商工債	0.400	2018/7/27	100,000,000	100.02	100,029,139	100.02	100,029,139	3.8
21	地方債証券	日本	第9回1号宮城県公募債（5年）	0.350	2018/7/26	100,000,000	100.02	100,026,003	100.02	100,026,003	3.8
22	地方債証券	日本	平成25年度第7回愛知県公募債（5年）	0.323	2018/7/11	100,000,000	100.01	100,010,548	100.01	100,010,548	3.8
23	社債券	日本	第55回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	0.001	2018/8/9	100,000,000	100.00	100,001,735	100.00	100,001,735	3.8

注1: 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価額の比率です。

注2: 組入全23銘柄について記載しています。

ロ) 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
地方債証券	26.7
特殊債券	15.3
社債券	47.3
合計	89.3

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】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（平成24年11月15日）	99	99	1.0405	1.0465
第2特定期間末（平成25年 5月15日）	1,136	1,144	1.3662	1.3762
第3特定期間末（平成25年11月15日）	1,463	1,474	1.2596	1.2696
第4特定期間末（平成26年 5月15日）	1,720	1,745	1.2175	1.2355
第5特定期間末（平成26年11月17日）	1,862	1,876	1.3684	1.3784
第6特定期間末（平成27年 5月15日）	1,441	1,451	1.3446	1.3546
第7特定期間末（平成27年11月16日）	1,121	1,130	1.3328	1.3428
第8特定期間末（平成28年 5月16日）	796	803	1.1853	1.1953
第9特定期間末（平成28年11月15日）	733	740	1.1594	1.1694
第10特定期間末（平成29年 5月15日）	748	755	1.1867	1.1967
第11特定期間末（平成29年11月15日）	714	721	1.1475	1.1575
第12特定期間末（平成30年 5月15日）	616	622	1.0209	1.0309
平成29年6月末日	725	-	1.1651	-
7月末日	708	-	1.1450	-
8月末日	711	-	1.1355	-
9月末日	731	-	1.1576	-
10月末日	733	-	1.1599	-
11月末日	708	-	1.1312	-
12月末日	715	-	1.1323	-
平成30年1月末日	680	-	1.0844	-
2月末日	660	-	1.0569	-
3月末日	637	-	1.0287	-
4月末日	629	-	1.0426	-
5月末日	626	-	1.0178	-
6月末日	607	-	1.0063	-

(注)分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

期	計算期間	1万口当たりの分配金（円）
第1特定期間末	平成24年 9月28日～平成24年11月15日	60
第2特定期間末	平成24年11月16日～平成25年 5月15日	480
第3特定期間末	平成25年 5月16日～平成25年11月15日	600
第4特定期間末	平成25年11月16日～平成26年 5月15日	1,080
第5特定期間末	平成26年 5月16日～平成26年11月17日	680
第6特定期間末	平成26年11月18日～平成27年 5月15日	600
第7特定期間末	平成27年 5月16日～平成27年11月16日	600
第8特定期間末	平成27年11月17日～平成28年 5月16日	600
第9特定期間末	平成28年 5月17日～平成28年11月15日	600
第10特定期間末	平成28年11月16日～平成29年 5月15日	600
第11特定期間末	平成29年 5月16日～平成29年11月15日	600
第12特定期間末	平成29年11月16日～平成30年 5月15日	600

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（％）
第1特定期間末	平成24年 9月28日～平成24年11月15日	4.7
第2特定期間末	平成24年11月16日～平成25年 5月15日	35.9
第3特定期間末	平成25年 5月16日～平成25年11月15日	3.4
第4特定期間末	平成25年11月16日～平成26年 5月15日	5.2
第5特定期間末	平成26年 5月16日～平成26年11月17日	18.0
第6特定期間末	平成26年11月18日～平成27年 5月15日	2.6
第7特定期間末	平成27年 5月16日～平成27年11月16日	3.6
第8特定期間末	平成27年11月17日～平成28年 5月16日	6.6
第9特定期間末	平成28年 5月17日～平成28年11月15日	2.9
第10特定期間末	平成28年11月16日～平成29年 5月15日	7.5
第11特定期間末	平成29年 5月16日～平成29年11月15日	1.8
第12特定期間末	平成29年11月16日～平成30年 5月15日	5.8

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(4)【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1特定期間末	平成24年 9月28日～平成24年11月15日	103,164,865	7,755,697
第2特定期間末	平成24年11月16日～平成25年 5月15日	847,882,622	111,731,007
第3特定期間末	平成25年 5月16日～平成25年11月15日	645,757,718	315,690,353
第4特定期間末	平成25年11月16日～平成26年 5月15日	743,460,758	491,961,520
第5特定期間末	平成26年 5月16日～平成26年11月17日	504,179,551	556,189,812
第6特定期間末	平成26年11月18日～平成27年 5月15日	372,578,705	661,969,425
第7特定期間末	平成27年 5月16日～平成27年11月16日	111,810,810	341,987,716
第8特定期間末	平成27年11月17日～平成28年 5月16日	40,281,794	209,759,977
第9特定期間末	平成28年 5月17日～平成28年11月15日	83,436,408	122,652,014
第10特定期間末	平成28年11月16日～平成29年 5月15日	86,298,323	88,228,562
第11特定期間末	平成29年 5月16日～平成29年11月15日	40,081,660	48,030,796
第12特定期間末	平成29年11月16日～平成30年 5月15日	47,319,866	66,156,165

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

末尾の参考情報を下記の通りとします。

参考情報

基準日：2018年6月29日

NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース(毎月分配型)

基準価額・純資産の推移



※分配金再投資基準価額、基準価額は1万口当たり、信託報酬控除後です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配額に再投資したとみなして計算したものです。

基準価額	10,063円
純資産総額	6.1億円

分配の推移

決算期	分配金
2018年1月	100円
2018年2月	100円
2018年3月	100円
2018年4月	100円
2018年5月	100円
2018年6月	100円
直近1年間累計	1,200円
設定来累計	7,200円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

主要投資対象であるNNケイマン・ファンズII-NN(C)アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの組入上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域名	業種	償還日	クーポン	比率
1	チャイナ・エバーグランデ・グループ	中国	不動産	2025/6/28	8.750%	3.5%
2	ウェルス・ドリブ	中国	コンプロマリット	2023/8/17	5.500%	3.3%
3	華僑城アジア	中国	不動産	永久債	4.300% 変動利付債	2.8%
4	東亜銀行	香港	金融	永久債	5.500% 変動利付債	2.8%
5	ナショナル・セービング・バンク	スリランカ	準ソブリン債等	2018/9/18	8.875%	2.6%
6	ウェスト・チャイナ・セメント	中国	資本財	2019/9/11	6.500%	2.6%
7	SMCグローバル・パフォー・ホールディングス	フィリピン	公益事業	永久債	7.500% 変動利付債	2.4%
8	CIFIホールディングス	中国	不動産	2020/6/5	7.750%	2.3%
9	カントリー・ガーデン・ホールディングス	中国	不動産	2021/4/4	7.250%	2.3%
10	シマオ・プロパティ・ホールディングス	中国	不動産	2022/7/3	4.750%	2.2%

※比率は当ファンドの主要投資対象である「NNケイマン・ファンズII-NN(C)アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」の純資産総額に対する割合です。

年間収益率の推移



※2012年は設定日(9月28日)から年末まで、2018年は6月末までの収益率です。

※収益率は税引前の分配金を再投資したとみなして計算しています。したがって、実際のファンドにおいては、課税条件等によって受益者ごとに収益率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。

※当ファンドにベンチマークはありません。

ファンドの運用実績は過去の実績であり、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。委託会社のホームページでファンドの運用状況を適宜開示しています。

第2【管理及び運営】

2【換金(解約)手続等】

(略)

< 訂正前 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (9:00 ~ 17:00土、日、祝日、年末年始を除く)

< 訂正後 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (営業日の9:00 ~ 17:00)

3【資産管理等の概要】

(略)

< 訂正前 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (9:00 ~ 17:00土、日、祝日、年末年始を除く)

< 訂正後 >

電話番号 03 - 5210 - 0653 (営業日の9:00 ~ 17:00)

第3【ファンドの経理状況】(下記の内容に訂正します。)

- (1) 当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の規則により、「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)に基づいて作成しております。
また、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) 当ファンドの計算期間は、6ヵ月未満であるため財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 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、当期(平成29年11月16日から平成30年5月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース（毎月分配型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期末 (平成29年11月15日現在)	当期末 (平成30年 5月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	13,703,258	13,528,194
投資信託受益証券	706,936,598	608,666,735
親投資信託受益証券	1,403,905	1,403,637
未収入金	6,000,000	-
流動資産合計	728,043,761	623,598,566
資産合計	728,043,761	623,598,566
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,229,763	6,041,400
未払解約金	6,001,186	-
未払受託者報酬	19,608	16,137
未払委託者報酬	914,875	752,926
その他未払費用	20,097	18,300
流動負債合計	13,185,529	6,828,763
負債合計	13,185,529	6,828,763
純資産の部		
元本等		
元本	622,976,335	604,140,036
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	91,881,897	12,629,767
元本等合計	714,858,232	616,769,803
純資産合計	714,858,232	616,769,803
負債純資産合計	728,043,761	623,598,566

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 至	平成29年 5月16日 平成29年11月15日	自 至	平成29年11月16日 平成30年 5月15日
営業収益				
受取配当金		24,935,743		20,707,496
有価証券売買等損益		6,036,823		57,270,131
営業収益合計		18,898,920		36,562,635
営業費用				
受託者報酬		118,051		107,958
委託者報酬		5,508,729		5,037,934
その他費用		24,891		23,111
営業費用合計		5,651,671		5,169,003
営業利益又は営業損失 ()		13,247,249		41,731,638
経常利益又は経常損失 ()		13,247,249		41,731,638
当期純利益又は当期純損失 ()		13,247,249		41,731,638
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 ()		139,776		502,903
期首剰余金又は期首欠損金 ()		117,789,577		91,881,897
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,726,402		5,143,623
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,726,402		5,143,623
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,192,467		5,961,106
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,192,467		5,961,106
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		37,549,088		37,205,912
期末剰余金又は期末欠損金 ()		91,881,897		12,629,767

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
	(2) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	(2) 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

前期末 (平成29年11月15日現在)	当期末 (平成30年 5月15日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数 622,976,335口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 604,140,036口
2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1475円 (10,000口当たり純資産額) (11,475円)	2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0209円 (10,000口当たり純資産額) (10,209円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成29年 5月16日 至 平成29年11月15日	当期 自 平成29年11月16日 至 平成30年 5月15日																																																																								
分配金の計算過程 平成29年 5月16日から平成29年 6月15日まで <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,238,311円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>164,972,234円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,070,708円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>169,281,253円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>625,372,355口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,706円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>100円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>6,253,723円</td> </tr> </tbody> </table> 平成29年 6月16日から平成29年 7月18日まで <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,976,022円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,238,311円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	164,972,234円	分配準備積立金額	D	1,070,708円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	169,281,253円	当ファンドの期末残存口数	F	625,372,355口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,706円	10,000口当たり分配金額	H	100円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,253,723円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,976,022円	分配金の計算過程 平成29年11月16日から平成29年12月15日まで <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,142,168円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>151,198,347円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>154,340,515円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>627,778,459口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,458円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>100円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>6,277,784円</td> </tr> </tbody> </table> 平成29年12月16日から平成30年 1月15日まで <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,156,993円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,142,168円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	151,198,347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	154,340,515円	当ファンドの期末残存口数	F	627,778,459口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,458円	10,000口当たり分配金額	H	100円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,277,784円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,156,993円
項目																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	3,238,311円																																																																							
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																							
収益調整金額	C	164,972,234円																																																																							
分配準備積立金額	D	1,070,708円																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	169,281,253円																																																																							
当ファンドの期末残存口数	F	625,372,355口																																																																							
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,706円																																																																							
10,000口当たり分配金額	H	100円																																																																							
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,253,723円																																																																							
項目																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	3,976,022円																																																																							
項目																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	3,142,168円																																																																							
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																							
収益調整金額	C	151,198,347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	154,340,515円																																																																							
当ファンドの期末残存口数	F	627,778,459口																																																																							
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,458円																																																																							
10,000口当たり分配金額	H	100円																																																																							
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,277,784円																																																																							
項目																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	3,156,993円																																																																							

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	162,383,896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	166,359,918円
当ファンドの期末残存口数	F	622,876,163口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,670円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,228,761円

平成29年 7月19日から平成29年 8月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,261,770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	0円
収益調整金額	C	158,991,383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	162,253,153円
当ファンドの期末残存口数	F	618,388,594口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,623円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,183,885円

平成29年 8月16日から平成29年 9月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,917,055円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	158,054,541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	161,971,596円
当ファンドの期末残存口数	F	626,251,156口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,586円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,262,511円

平成29年 9月16日から平成29年10月16日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,834,418円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	158,933,888円
分配準備積立金額	D	0円

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	148,262,825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	151,419,818円
当ファンドの期末残存口数	F	628,613,515口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,408円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,286,135円

平成30年 1月16日から平成30年 2月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,131,737円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	143,686,270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	146,818,007円
当ファンドの期末残存口数	F	622,341,239口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,359円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,223,412円

平成30年 2月16日から平成30年 3月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,093,312円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	140,788,419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	142,881,731円
当ファンドの期末残存口数	F	623,198,163口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,292円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,231,981円

平成30年 3月16日から平成30年 4月16日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,612,228円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	134,747,312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	$E=A+B+C+D$	162,768,306円
当ファンドの期末残存口数	F	639,044,529口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,547円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	6,390,445円

平成29年10月17日から平成29年11月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,721,353円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	152,450,876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	$E=A+B+C+D$	156,172,229円
当ファンドの期末残存口数	F	622,976,335口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,506円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	6,229,763円

当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	137,359,540円
当ファンドの期末残存口数	F	614,520,039口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,235円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	6,145,200円

平成30年 4月17日から平成30年 5月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,978,425円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	128,998,163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	$E=A+B+C+D$	130,976,588円
当ファンドの期末残存口数	F	604,140,036口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,167円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	6,041,400円

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

前期 自 平成29年 5月16日 至 平成29年11月15日	当期 自 平成29年11月16日 至 平成30年 5月15日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品を主たる投資対象として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその他金融商品に係るリスク 当ファンドは、有価証券、金銭信託、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務を保有しております。保有する有価証券の内容については、有価証券に関する注記に記載されております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク等を有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその他金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

<p>委託会社において、投資リスク管理に関する独立した委員会を設けており、当該委員会でパフォーマンスの分析及び投資リスクの管理を行っております。パフォーマンスの分析では、投資行動及び資金運用がポートフォリオのパフォーマンス実績に与えた影響を定期的に分析し、評価しております。また、投資リスクの管理においては、コンプライアンス・リスク管理本部及びCIO（チーフ・インベストメント・オフィサー）が信託約款等の遵守状況、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等をモニターしており、委員会において報告されております。</p> <p>市場リスクの管理 価格変動リスク、為替変動リスク及び金利変動リスクについては、ファンド商品特性に照らしてポートフォリオにおけるリスクと想定されるリスクとを比較分析することによって管理しております。</p> <p>信用リスク及び流動性リスクの管理 格付やその他発行体及び取引先に関する情報を収集・分析のうえ、ファンドの商品特性に照らして組入銘柄の信用リスクを管理しております。また、市場流動性の状況を把握し、流動性リスクを管理しております。</p> <p>4.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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。</p>	<p>同左</p> <p>4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>
--	---

2.金融商品の時価等に関する事項

前期末 (平成29年11月15日現在)	当期末 (平成30年 5月15日現在)
<p>1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 当ファンドの保有する金融商品は原則としてすべて時価評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2.時価の算定方法 投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しているため省略しております。 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しているため省略しております。 金銭信託、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは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、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	前期 自 平成29年 5月16日 至 平成29年11月15日	当期 自 平成29年11月16日 至 平成30年 5月15日
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	5,455,464	5,273,384
親投資信託受益証券	-	-
合計	5,455,464	5,273,384

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 平成29年 5月16日 至 平成29年11月15日	当期 自 平成29年11月16日 至 平成30年 5月15日
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

元本の移動

前期 自 平成29年 5月16日 至 平成29年11月15日	当期 自 平成29年11月16日 至 平成30年 5月15日
期首元本額 630,925,471円	期首元本額 622,976,335円
期中追加設定元本額 40,081,660円	期中追加設定元本額 47,319,866円
期中一部解約元本額 48,030,796円	期中一部解約元本額 66,156,165円

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
----	----	----	--------	----

投資信託受益証券	NNケイマン・ファンズ イ・イールド・ボンド・ファンド 米ドルクラス	454,602,088	608,666,735	
投資信託受益証券 小計		454,602,088	608,666,735	
親投資信託受益証券	NN短期債券マザーファンド	1,339,221	1,403,637	
親投資信託受益証券 小計		1,339,221	1,403,637	
合計		455,941,309	610,070,372	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「NN短期債券マザーファンド」の受益証券を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、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

また、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

NN短期債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年 5月15日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	321,607,958
地方債証券	1,103,161,856
特殊債券	400,252,268
社債券	1,039,721,321
未収利息	4,312,760
前払費用	3,238,342
流動資産合計	2,872,294,505
資産合計	2,872,294,505
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	25,792
流動負債合計	25,792
負債合計	25,792
純資産の部	
元本等	
元本	2,740,553,321

剰余金	
剰余金又は欠損金()	131,715,392
元本等合計	<u>2,872,268,713</u>
純資産合計	<u>2,872,268,713</u>
負債純資産合計	<u>2,872,294,505</u>

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、償却原価法により評価しております。 ただし、時価と評価額に乖離が生じ、適正な基準価額の計算上必要と判断した場合には、速やかに時価に評価換えしております。
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

(平成30年 5月15日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,740,553,321口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0481円
(10,000口当たり純資産額)	(10,481円)

(その他の注記)

(平成30年 5月15日現在)	
子ファンドの期首	平成29年11月16日
期首元本額	2,257,765,611円
対象期間中の追加設定元本額	733,475,443円
対象期間中の一部解約元本額	250,687,733円
期末元本額	2,740,553,321円
平成30年 5月15日現在の元本の内訳	
NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース(毎月分配型)	3,675,910円
NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース(毎月分配型)	1,339,221円
NN欧州リート・ファンド(毎月決算コース/為替ヘッジなし)	6,793,998円
NN欧州リート・ファンド(資産形成コース/為替ヘッジなし)	1,914,516円
NN欧州リート・ファンド(毎月決算コース/為替ヘッジあり)	2,480,927円
NN欧州リート・ファンド(資産形成コース/為替ヘッジあり)	1,669,863円
NN欧州リート・ファンド(毎月決算コース/通貨カバード・コール戦略)	3,339,377円
NN欧州リート・ファンド(資産形成コース/通貨カバード・コール戦略)	209,922円
NNライフアップ株式ファンド(為替ヘッジなし/年2回決算型)	8,583円
NNライフアップ株式ファンド(為替ヘッジなし/資産成長型)	8,583円
NNライフアップ株式ファンド(為替ヘッジあり/年2回決算型)	8,583円
NNライフアップ株式ファンド(為替ヘッジあり/資産成長型)	8,583円
NNグローバルバランスファンドVA(株25型)(適格機関投資家専用)	92,458,490円
NNグローバルバランスファンドVA(株50型)(適格機関投資家専用)	32,017,550円
NNグローバルバランスファンドVA(株70型)(適格機関投資家専用)	27,713,362円
NNマネープールVA(適格機関投資家専用)	2,566,905,853円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
地方債証券	日本円	第662回東京都公募公債	100,000,000	100,585,676	
		平成20年度第7回北海道公募公債	100,000,000	100,616,862	
		第9回1号宮城県公募公債(5年)	100,000,000	100,069,248	
		第99回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,115,894	
		平成20年度第3回兵庫県公募公債	100,000,000	100,032,716	
		平成25年度第7回愛知県公募公債(5年)	100,000,000	100,049,968	
		平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,038,188	
		平成25年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	100,007,312	
		平成20年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	100,916,572	
		平成25年度第2回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	100,031,350	
		平成20年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	100,698,070	
		小計	銘柄数: 11 組入時価比率: 38.41%	1,100,000,000	1,103,161,856 43.38%
	合計			1,103,161,856	
特殊債券	日本円	い第758号商工債	100,000,000	100,075,894	
		い第757号農林債	100,000,000	100,039,022	
		第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,039,022	
		第285回信金中金債(5年)	100,000,000	100,098,330	
		小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 13.94%	400,000,000	400,252,268 15.74%
	合計			400,252,268	

社債券	日本円	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,164,496	
		第55回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	100,003,490	
		第24回都市再生債券	100,000,000	100,977,100	
		第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,188,775	
		第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,662,980	
		第22回国際協力機構債券	135,500,000	135,716,105	
		第17回株式会社豊田自動織機無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,601,585	
		第25回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,052,312	
		第469回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,755,114	
		第357回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,599,364	
		小計	銘柄数：10 組入時価比率：36.20%	1,035,500,000	1,039,721,321 40.88%
合計			1,039,721,321		
合計				2,543,135,445	

(注)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】(訂正後の内容のみ記載しております。)

【純資産額計算書】平成30年6月29日

資産総額	617,300,390円
負債総額	9,854,216円
純資産総額（ - ）	607,446,174円
発行済口数	603,648,238口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0063円
（1万口当たり純資産額）	（10,063円）

(参考)

「NN短期債券マザーファンド」の純資産額計算書

資産総額	2,828,472,157円
負債総額	202,872,110円
純資産総額（ - ）	2,625,600,047円
発行済口数	2,505,237,029口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0480円
（1万口当たり純資産額）	（10,480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12月末現在)

< 訂正後 >

(1) 資本金の額 (平成30年6月末現在)

2【事業の内容及び営業の概況】(下記の内容に訂正します。)

「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」に定める投資助言業および第一種金融商品取引業を行っています。

平成30年6月末現在委託会社の運用する証券投資信託は次の通りです。ただし、親投資信託を除きます。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	38	202,372
合計	38	202,372

3【委託会社等の経理状況】(下記の内容に訂正します。)

- (1) 委託会社であるNNインベストメント・パートナーズ株式会社(以下「委託会社」という)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)ならびに同規則第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。
- (2) 法令の規定に基づき、委託会社の財務諸表については有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。
- (3) 委託会社は定款を一部変更し、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19期事業年度は平成29年4月1日から平成29年12月31日までとなっております。

(1) 【貸借対照表】

期別 科目	第18期 (平成29年3月31日)			第19期 (平成29年12月31日)		
	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
(資産の部)	千円	千円	%	千円	千円	%
流動資産						
現金・預金		2,713,331			2,677,737	
立替金		842			316	
未収委託者報酬		166,092			173,190	
未収運用受託報酬		141,452			134,682	
その他の未収収益		106,639			96,809	
前払費用		18,553			20,284	
繰延税金資産		24,204			59,875	
流動資産計		3,171,116	96.8		3,162,897	97.1
固定資産						
有形固定資産 1		59,746			50,719	
建物附属設備	32,635			28,561		
器具備品	17,798			14,323		
リース資産	9,312			7,833		
無形固定資産		1,195			695	
ソフトウェア	1,195			695		
投資その他の資産		44,559			44,033	
長期差入保証金	40,439			40,805		
繰延税金資産	4,120			3,227		
固定資産計		105,501	3.2		95,447	2.9
資産合計		3,276,618	100.0		3,258,344	100.0

期別	第18期 (平成29年3月31日)			第19期 (平成29年12月31日)		
	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
(負債の部)	千円	千円	%	千円	千円	%
流動負債						
未払手数料		42,492			45,029	
未払投資顧問料		85,284			102,310	
未払投資助言料		23,124			23,966	
未払金		35,844			47,950	
未払費用		24,280			24,928	
リース債務		2,197			2,229	
未払法人税等		109,834			64,867	
未払消費税等		42,498			21,990	
預り金		79,053			15,989	
賞与引当金		30,137			126,796	
役員賞与引当金		16,575			54,612	
流動負債計		491,323	15.0		530,670	16.3
固定負債						
長期未払金		6,361			5,089	
リース債務		8,577			6,900	
賞与引当金		13,351			10,459	
役員賞与引当金		11,373			6,972	
退職給付引当金		566,824			579,049	
役員退職慰労引当金		76,036			86,901	
固定負債計		682,525	20.8		695,373	21.3
負債合計		1,173,848	35.8		1,226,043	37.6
科目	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
(純資産の部)	千円	千円	%	千円	千円	%
株主資本						
資本金		480,000	14.6		480,000	14.7
資本剰余金						
資本準備金	1,390,000			1,390,000		
資本剰余金計		1,390,000	42.4		1,390,000	42.7
利益剰余金						
その他利益剰余金						
繰越利益剰余金	232,769			162,300		
利益剰余金計		232,769	7.1		162,300	5.0
株主資本合計		2,102,769	64.2		2,032,300	62.4
純資産合計		2,102,769	64.2		2,032,300	62.4
負債純資産合計		3,276,618	100.0		3,258,344	100.0

（２）【損益計算書】

	第18期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)			第19期 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)		
	内訳	金額	百分比	内訳	金額	百分比
	千円	千円	%	千円	千円	%
営業収益						
委託者報酬	789,993			569,274		
運用受託報酬	1,345,058			1,030,924		
投資助言報酬	118			-		
その他営業収益	408,377			317,939		
営業収益計		2,543,548	100.0		1,918,138	100.0
営業費用						
支払手数料		229,296			163,431	
支払投資顧問料		345,403			250,094	
支払投資助言料		26,143			44,950	
広告宣伝費		21,076			4,525	
調査費		122,239			97,054	
調査費	121,349			96,274		
図書費	889			780		
委託計算費		42,301			28,470	
業務委託費		6,394			3,615	
営業雑経費		48,989			31,496	
通信費	6,126			4,092		
印刷費	18,652			12,697		
協会費	5,821			5,051		
諸会費	2,986			1,035		
その他営業費用	15,402			8,619		
営業費用計		841,846	33.1		623,637	32.5
一般管理費						
給料		786,193			660,448	
役員報酬	78,361			58,771		
給料・手当	572,970			424,623		
賞与	60,964			22,880		
賞与引当金繰入額	32,597			104,433		
役員賞与	22,628			7,017		
役員賞与引当金繰入額	18,671			42,722		
福利厚生費		127,434			91,899	
交際費		7,973			6,131	
旅費交通費		26,433			23,010	
租税公課		28,267			21,255	
不動産賃借料		59,753			44,907	
退職給付費用		97,604			74,001	

	第18期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)			第19期 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)		
	内訳	金額	百分比	内訳	金額	百分比
	千円	千円	%	千円	千円	%
役員退職慰労引当金繰入額		13,610			10,864	
固定資産減価償却費		16,385			9,528	
経営指導料		11,975			8,353	
監査費用		15,031			16,315	
諸経費		60,795			53,091	
一般管理費計		1,251,460	49.2		1,019,805	53.2
営業利益		450,242	17.7		274,694	14.3
営業外収益						
受取利息	20			9		
受取配当金	179			172		
有価証券売却益	81			-		
還付加算金	-			21		
営業外収益計		281	0.0		203	0.0
営業外費用						
支払利息	152			150		
為替換算差損	23,405			4,252		
雑損失	2,348			98		
営業外費用計		25,905	1.0		4,501	0.2
経常利益		424,617	16.7		270,397	14.1
特別損失						
固定資産除却損 1	4,488			-		
特別損失計		4,488	0.2		-	-
税引前当期純利益		420,128	16.5		270,397	14.1
法人税、住民税及び事業税		168,561	6.6		143,297	7.5
法人税等調整額		7,213	0.3		34,778	1.8
当期純利益		258,780	10.2		161,878	8.4

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			その他 有価証券 評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	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	480,000	1,390,000	1,390,000	203,999	203,999	2,073,999	-	-	2,073,999
当期変動額									
剰余金の配当				230,010	230,010	230,010			230,010
当期純利益				258,780	258,780	258,780			258,780
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	28,770	28,770	28,770	-	-	28,770
当期末残高	480,000	1,390,000	1,390,000	232,769	232,769	2,102,769	-	-	2,102,769

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			その他 有価証券 評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	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	480,000	1,390,000	1,390,000	232,769	232,769	2,102,769	-	-	2,102,769
当期変動額									
剰余金の配当				232,347	232,347	232,347			232,347
当期純利益				161,878	161,878	161,878			161,878
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	70,469	70,469	70,469	-	-	70,469
当期末残高	480,000	1,390,000	1,390,000	162,300	162,300	2,032,300	-	-	2,032,300

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) その他有価証券

時価のあるもの

決算期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．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

(イ) リース資産以外の有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物附属設備	6～18年
器具備品	4～20年

(ロ) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとする定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法により償却しております。なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における利用可能期間（5年）による定額法を採用しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額の当期負担分を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払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

従業員の退職金支給に充てるため、退職給付会計に関する実務指針に定める簡便法（退職金規程等にもとづく期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法）により計上しております。

(4) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

(1) 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。

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

消費税等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18期 (平成29年3月31日現在)		第19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
	建物附属設備 21,046千円		建物附属設備 25,120千円
	器具備品 36,454千円		器具備品 38,280千円
	リース資産 548千円		リース資産 2,027千円

(損益計算書関係)

第18期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日		第19期 自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日	
1	固定資産除却損の内容は次のとおりであります。		
	リース資産 4,488千円		

(株主資本等変動計算書関係)

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

第18期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

株式の種類	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
普通株式	9,350	-	-	9,350

第19期（自平成29年4月1日至平成29年12月31日）

株式の種類	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
普通株式	9,350	-	-	9,350

2. 配当に関する事項

第18期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年 6月30日 臨時株主総会	普通株式	149,600	16,000.00	平成28年3月31日	平成28年7月1日
平成28年 12月28日 臨時株主総会	普通株式	80,410	8,600.00	平成28年9月30日	平成28年12月29日

第19期（自平成29年4月1日至平成29年12月31日）

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成29年 6月27日 株主総会	普通株式	232,347	24,850.00	平成29年3月31日	平成29年6月28日

(リース取引関係)

1. 所有権移転外ファイナンス・リース取引

(1) リース資産の内容

有形固定資産

人事総務部が主管するコピー機であります。

(2) リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載の通りであります。

(金融商品に関する注記)

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、投資運用業及び投資助言・代理業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っており、手数料収入から生じる余資運用については短期的な預金等に限定しております。積極的な運用は行っていないため特に資金調達は行っておりません。またデリバティブ等の投機的な取引は行わない方針であります。

(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

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、信託財産から支払われる委託者に対する報酬の未払い金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されていることから信用リスクはほとんどないものと認識しております。また営業債権である未収運用受託報酬とその他未収収益の基礎となる預かり資産は、受託銀行の固有財産と分別管理されており、未収運用受託報酬とその他未収収益は当該信託財産の負債項目に計上されていることから信用リスクはほとんどないものと認識しております。

国外拠点に対する外貨建ての債権債務に関しては、決済日から決済されるまで最長6ヶ月間の為替変動によるリスクに晒されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

前事業年度末（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	2,713,331	2,713,331	-
(2) 未収委託者報酬	166,092	166,092	-
(3) 未収運用受託報酬	141,452	141,452	-
(4) その他の未収収益	106,639	106,639	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、ならびに(4) その他の未収収益
これらは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によっております。

(注2) 長期差入保証金（貸借対照表計上額40,439千円）は市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超
(1) 現金・預金	2,713,331	-
(2) 未収委託者報酬	166,092	-
(3) 未収運用受託報酬	141,452	-
(4) その他の未収収益	106,639	-
合計	3,127,516	-

当事業年度末（平成29年12月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	2,677,737	2,677,737	-
(2) 未収委託者報酬	173,190	173,190	-
(3) 未収運用受託報酬	134,682	134,682	-
(4) その他の未収収益	96,809	96,809	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、ならびに(4) その他の未収収益
これらは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によっております。

（注2）長期差入保証金（貸借対照表計上額40,805千円）は市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超
(1) 現金・預金	2,677,737	-
(2) 未収委託者報酬	173,190	-
(3) 未収運用受託報酬	134,682	-
(4) その他の未収収益	96,809	-
合計	3,082,420	-

（有価証券関係）

1．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度末（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

区分	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
投資信託	4,081	121	40
合計	4,081	121	40

当事業年度末（自平成29年4月1日 至平成29年12月31日）

該当ありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型の制度として、会社設立時より退職一時金制度を設けております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	518,560 千円
退職給付費用	97,604 千円
退職給付の支払額	49,340 千円
退職給付引当金の期末残高	566,824 千円

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 97,604 千円

当事業年度（自平成29年4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

当社は確定給付型の制度として、会社設立時より退職一時金制度を設けております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	566,824 千円
退職給付費用	74,001 千円
退職給付の支払額	61,774 千円
<hr/>	
退職給付引当金の期末残高	579,049 千円

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	74,001 千円
----------------	-----------

（税効果会計関係）

第18期 （平成29年3月31日現在）	第19期 （平成29年12月31日現在）
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主 原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主 原因別の内訳
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 13,420千円	賞与引当金 42,357千円
退職給付引当金 174,921	退職給付引当金 178,694
役員退職慰労引当金 23,464	役員退職慰労引当金 26,817
未払費用 7,493	未払費用 7,692
未払事業税 7,410	未払事業税 4,155
資産除去債務 1,347	資産除去債務 1,749
その他 3,564	その他 12,461
繰延税金資産小計 231,622	繰延税金資産小計 273,929
評価性引当額 203,298	評価性引当額 210,826
繰延税金資産合計 28,324	繰延税金資産合計 63,103
繰延税金資産の純額 28,324	繰延税金資産の純額 63,103
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等 の負担率との間の差異の原因となった主要な 項目別内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等 の負担率との間の差異の原因となった主要な 項目別内訳
（％）	（％）
法定実効税率 30.9	法定実効税率 30.9
（調整）	（調整）
評価性引当額の増減 4.6	評価性引当額の増減 2.7
交際費等永久に損金に算入 されない項目 3.4	交際費等永久に損金に算入 されない項目 6.3
住民税均等割 0.2	住民税均等割 0.2
前期確定申告差異 0.1	前期確定申告差異 0.1
税率変更による期末繰延税 金資産の減額修正 -	その他 0.1
その他 0.6	税効果会計適用後の法人税 等の負担率 40.1
税効果会計適用後の法人税 等の負担率 38.4	

（資産除去債務関係）

第18期 （平成29年3月31日現在）	第19期 （平成29年12月31日現在）
記載すべき重要な事項はありません。	記載すべき重要な事項はありません。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当社は、資産運用業の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〕

1. 商品及びサービスのごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が当事業年度損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

前事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

（単位：千円）

日本	欧州	米州	合計
1,345,177	191,389	216,987	1,753,555

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国または地域に分類しております。

なお、委託者報酬789,993千円については、制度上、顧客情報を知りえないため、含まれておりません。

当事業年度（自平成29年4月1日 至平成29年12月31日）

（単位：千円）

日本	欧州	米州	合計
1,030,924	135,090	182,849	1,348,864

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国または地域に分類しております。

なお、委託者報酬569,274千円については、制度上、顧客情報を知りえないため、含まれておりません。

(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当事業年度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

前事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益	関連するセグメント
エヌエヌ生命保険株式会社	1,298,857	資産運用業

（注）委託者報酬については、制度上、顧客情報を知りえないため、記載を省略しております。

当事業年度（自平成29年4月1日 至平成29年12月31日）

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益	関連するセグメント
エヌエヌ生命保険株式会社	996,930	資産運用業

（注）委託者報酬については、制度上、顧客情報を知りえないため、記載を省略しております。

[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

前事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

（ア）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権等 の所有 (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)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
同一の親会社 を持つ会社	NNインベスト メントパートナ ーズ	オランダ、 ハーグ	463,553 ユーロ	投資 顧問業	なし	なし	運用 委託	業務受託 報酬の受 取	368,371	未収 入金	100,650
同一の親会社 を持つ会社	エヌエヌ生命保 険（株）	東京都 千代田区	324億円	保険業	なし	なし	投資 顧問	投資顧問 料	1,298,857	未収 入金	118,629

（注）（1）上記（ア）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せん。

（2）取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1．投資顧問料の受取については当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算しております。
- 2．業務受託に関する報酬の受取については当社との間で締結された業務委託契約に基づき計算しております。

当事業年度（自平成29年4月1日 至平成29年12月31日）

（ア）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権等 の所有 (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)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
同一の親会社 を持つ会社	NNインベスト メントパートナ ーズ	オランダ、 ハーグ	463,553 ユーロ	投資 顧問業	なし	なし	運用 委託	業務受託 報酬の受 取	283,142	未収 入金	82,395
同一の親会社 を持つ会社	エヌエヌ生命保 険（株）	東京都 千代田区	324億円	保険業	なし	なし	投資 顧問	投資顧問 料の受取	996,930	未収 入金	121,262

（注）（1）上記（ア）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せん。

（2）取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1．投資顧問料の受取については当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算しております。
- 2．業務受託に関する報酬の受取については当社との間で締結された業務委託契約に基づき計算しております。

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

NN Group N.V.（ユーロネクスト・アムステルダム証券取引所に上場）

NN Insurance Eurasia N.V.（非上場）

NN Investment Partners Holdings N.V.（非上場）

NN Investment Partners International Holdings B.V.（非上場）

（ 1株当たり情報）

第18期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日		第19期 自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日	
1株当たり純資産額	224,895円15銭	1株当たり純資産額	217,358円38銭
1株当たり当期純利益金額	27,677円05銭	1株当たり当期純利益金額	17,313円22銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期利益金額については、希薄化効果を有している潜在株式が存在しないため記載しておりません。</p> <p>（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。</p>		<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期利益金額については、希薄化効果を有している潜在株式が存在しないため記載しておりません。</p> <p>（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。</p>	
第18期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日		第19期 自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日	
当期純利益（千円）	258,780	当期純利益（千円）	161,878
普通株主に帰属しない金額	-	普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	258,780	普通株式にかかる当期純利益（千円）	161,878
普通株式の期中平均株式数（株）	9,350	普通株式の期中平均株式数（株）	9,350

（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】（下記の内容に訂正します。）

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	資本金の額 (平成30年6月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	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。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成30年6月末現在)	事業の内容
岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	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。
株式会社証券ジャパン	3,000百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	
日産証券株式会社	1,500百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
株式会社SMBC信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて証券投資信託の取扱いを行っています。
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社として信託財産の保管・管理・計算等を行います。

(2) 販売会社

販売会社として、募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の取扱い等の業務を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(参考情報)

< 再信託受託会社 >

名称	日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
資本金	51,000百万円(平成30年6月末現在)
事業の内容	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。

独立監査人の監査報告書

平成30年7月20日

NNインベストメント・パートナーズ株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 野島 浩一郎
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NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース（毎月分配型）の平成29年11月16日から平成30年5月15日までの特定期間の財務諸表、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、NNアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース（毎月分配型）の平成30年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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

NNインベストメント・パートナーズ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（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2. XBRL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30年3月15日

NNインベストメント・パートナーズ株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 野島 浩一郎
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NNインベストメント・パートナーズ株式会社の平成29年4月1日から平成29年12月31日までの第19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、その他の注記及び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、NNインベストメント・パートナーズ株式会社の平成29年12月31日現在の財政状態並びに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

(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。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。