

【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5月17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
受益証券に係るファンドの名称】 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)
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)

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】 各ファンドにつき継続募集額5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1.【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成30年5月17日に有価証券報告書を提出しました。これに伴い、平成29年11月20日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の「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が同じで、決算頻度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。

ファンドの特色

特色
1

世界の生活必需品関連企業の株式に投資をします。

生活必需品関連企業とは、生活必需品のメーカーならびに小売販売等を行う企業をいいます。

食品・飲料・たばこのメーカー 製造品の例



家庭用品・パーソナル用品のメーカー 製造品の例



生活必需品の小売業 例



特色2 為替ヘッジあり・なしと分配方針の組み合わせからお選びいただけます。

		為替ヘッジなし 為替ヘッジを行いません。	為替ヘッジあり 対円で為替ヘッジを行うことにより、 為替変動リスクの低減を図ります。
分配方針	年2回決算型 年2回の決算時に収益分配を行うことをめざします。 ・毎年2月20日および8月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。 ・基準価額の水準等を勘案し、キャピタルゲインを中心に分配を行うことをめざします。	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)	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)
	資産成長型 年1回決算を行います。 ・毎年8月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。 ・信託財産の成長を重視し、分配を行わないことがあります。	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)	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)

※分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入(繰越分を含みます。)および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
 ※分配金額は基準価額水準等を勘案して委託会社が決定します。将来の分配金額を保証するものではなく、運用実績に応じて変動します。分配金額が変更される場合や分配を行わない場合もあります。
 ※受益者のファンドの購入価額によっては、分配金額の一部または全部が、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。

特色3 主要投資対象とする投資信託証券の運用はNNインベストメント・パートナーズB.V.が行います。

- NNインベストメント・パートナーズはNNグループの資産運用部門で、オランダを本拠とし、欧州、アジア、米国に拠点を構え、グローバルに資産運用業務を展開しています。NNインベストメント・パートナーズB.V.は欧州における運用拠点のひとつです。
- NNグループは欧州と日本を主な拠点とし、保険事業および資産運用事業を展開しています。NNグループの持株会社であるNNグループN.V.はユーロネクスト・アムステルダムに上場しています。

NNインベストメント・パートナーズのグローバルネットワーク



※赤字は主な運用拠点(2017年12月末現在)

活動拠点

15カ国

運用資産額

約33.3兆円*

* 1ユーロ=135.24円で換算
 * 運用資産額のうち約7.0兆円はデルタ・ロイド・アセット・マネジメントのもの

従業員

約1,200人

(2017年12月末現在)

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

< 投資対象とする投資信託証券の概要 >

NN短期債券マザーファンド

(略)

< 訂正前 >

シティ世界マネーマーケットインデックス(日本円3ヵ月ユーロ預金)をベンチマークとします。

< 訂正後 >

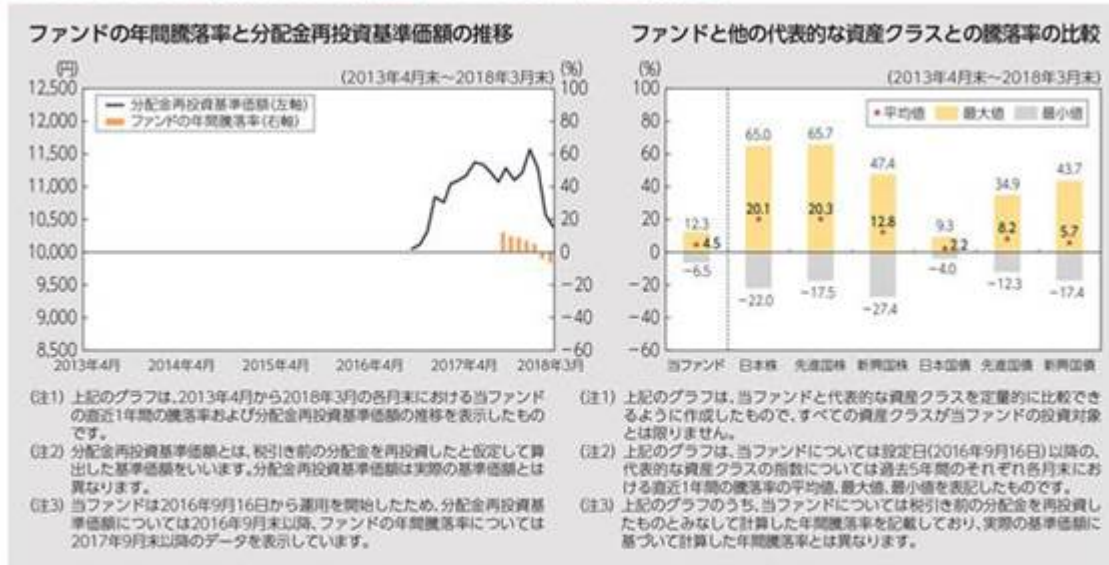
FTSE世界マネーマーケットインデックス(日本円3ヵ月ユーロ預金)をベンチマークとします。

3【投資リスク】

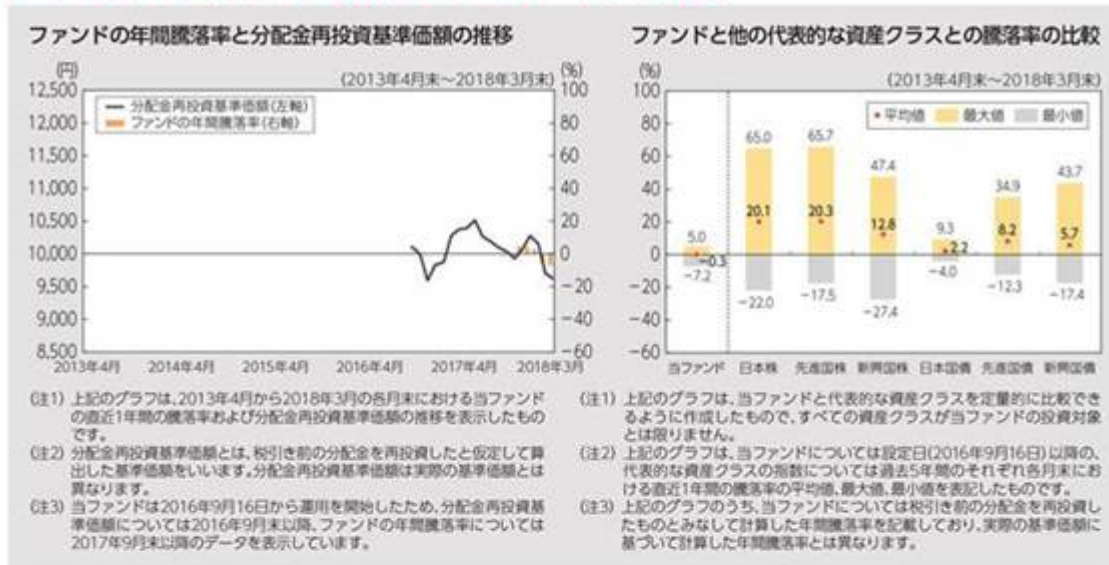
(略)

参考情報(下記の内容に訂正します。)

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)



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)



各資産クラスの指数

日本株……TOPIX(配当込み)
 先進国株……MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
 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)
 日本国債……NOMURA-BPI国債
 先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 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)
 ※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

- (注1) 騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所および各指数のデータソースは、その内容について、信頼性、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いません。また、株式会社野村総合研究所および各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に対応する損害および一切の損害について、何らの責任も負いません。
- (注2) TOPIX(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。
- (注3) MSCIコクサイ・インデックス(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。
- (注4) 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。
- (注5) 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。
- (注6) 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、JPMorgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(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係る管理、カストディ、監査、リーガル等の業務にかかる費用等(年率0.20%)、および租税、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、取引税、借入金や立替金に関する利息等がかかります。また、ファンドが投資対象とする投資信託証券の「NN(L)フード・アンド・ビバレッジ 年2回分配シェア クラスI(円ヘッジ)」については、為替ヘッジにかかる手数料(最大年率0.04%)がかかります。

上記の費用等のうち、具体的な料率が記載してあるものについては平成29年9月29日現在の料率であり、今後変動する可能性があります。

<訂正後>

ファンドが投資対象とする投資信託証券に係る管理、カストディ、監査、リーガル等の業務にかかる費用等(年率0.20%)、および租税、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、取引税、借入金や立替金に関する利息等がかかります。また、ファンドが投資対象とする投資信託証券の「NN(L)フード・アンド・ビバレッジ 年2回分配シェア クラスI(円ヘッジ)」については、為替ヘッジにかかる手数料(最大年率0.04%)がかかります。

上記の費用等のうち、具体的な料率が記載してあるものについては平成30年3月30日現在の料率であり、今後変動する可能性があります。

5【運用状況】(下記の内容に訂正します。)

(1)【投資状況】

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)

(平成30年3月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	ルクセンブルグ	417,416,094	99.0
親投資信託受益証券	日本	8,995	0.0
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,093,908	1.0
合計(純資産総額)		421,518,997	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。

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)

(平成30年3月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	ルクセンブルグ	116,847,257	98.9
親投資信託受益証券	日本	8,995	0.0
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,342,396	1.1
合計(純資産総額)		118,198,648	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3月30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	902,407,926	30.4
特殊債券	日本	300,285,176	10.1
社債券	日本	1,241,482,753	41.8
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	528,099,108	17.7
合計(純資産総額)		2,972,274,963	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3月30日現在)

1.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)

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(L)フード・アンド・ビバレッジ 年2回分配シェア クラスI (円建て)	-	39,829.78	10,669	424,943,922	10,480	417,416,094	99.0
NN短期債券マザーファンド	-	8,583	1.0481	8,995	1.0481	8,995	0.0

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	99.0
親投資信託受益証券	0.0

合計	99.0
----	------

2. 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)

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(L)フード・アンド・ビバレッジ 年2回分配シェア クラスI (円ヘッジ)	-	12,080.982	9,812	118,538,595	9,672	116,847,257	98.9
NN短期債券マザーファンド	-	8,583	1.0481	8,995	1.0481	8,995	0.0

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	98.9
親投資信託受益証券	0.0
合計	98.9

【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3月30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	地方債証券	日本	平成25年度第2回静岡県公債 (5年)	0.163	2018/4/19	200,000,000	100.00	200,017,562	100.00	200,017,562	6.7
2	社債券	日本	第22回国際協力機構債券	0.260	2018/12/20	135,500,000	100.19	135,761,461	100.19	135,761,461	4.6
3	社債券	日本	第24回都市再生債券	1.910	2018/11/22	100,000,000	101.21	101,212,390	101.21	101,212,390	3.4
4	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	100.96	100,968,140	100.96	100,968,140	3.4
5	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	100.90	100,901,168	100.90	100,901,168	3.4
6	地方債証券	日本	平成20年度第7回北海道公債	1.720	2018/9/25	100,000,000	100.83	100,830,164	100.83	100,830,164	3.4
7	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	100.81	100,817,739	100.81	100,817,739	3.4
8	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	100.80	100,806,640	100.80	100,806,640	3.4
9	地方債証券	日本	第662回東京都公債	1.670	2018/9/20	100,000,000	100.79	100,796,080	100.79	100,796,080	3.4
10	社債券	日本	第17回独立行政法人福祉医療機構 債券	1.990	2018/6/20	100,000,000	100.42	100,429,953	100.42	100,429,953	3.4
11	社債券	日本	第40回日本高速道路保有・債務返 済機構債券	1.690	2018/6/20	100,000,000	100.37	100,374,624	100.37	100,374,624	3.4
12	地方債証券	日本	平成20年度第1回広島県公債	1.800	2018/5/23	100,000,000	100.25	100,257,424	100.25	100,257,424	3.4
13	地方債証券	日本	平成20年度第3回兵庫県公債	1.760	2018/5/22	100,000,000	100.24	100,247,168	100.24	100,247,168	3.4
14	地方債証券	日本	第99回大阪府公債(5年)	0.240	2018/10/30	100,000,000	100.14	100,147,588	100.14	100,147,588	3.4
15	特殊債券	日本	い第758号商工債	0.400	2018/7/27	100,000,000	100.12	100,123,688	100.12	100,123,688	3.4
16	社債券	日本	第25回株式会社ホンダファイナ ンス無担保社債	0.554	2018/6/20	100,000,000	100.11	100,119,058	100.11	100,119,058	3.4
17	特殊債券	日本	い第757号農林債	0.350	2018/6/27	100,000,000	100.08	100,080,744	100.08	100,080,744	3.4
18	特殊債券	日本	第283回信金中金債(5年)	0.350	2018/6/27	100,000,000	100.08	100,080,744	100.08	100,080,744	3.4
19	地方債証券	日本	平成25年度第2回札幌市公債 (5年)	0.310	2018/6/20	100,000,000	100.07	100,071,140	100.07	100,071,140	3.4
20	社債券	日本	第420回九州電力株式会社社債 (一般担保付)	0.820	2018/4/25	100,000,000	100.05	100,054,444	100.05	100,054,444	3.4
21	地方債証券	日本	平成25年度第2回千葉県公債	0.260	2018/5/25	100,000,000	100.04	100,040,800	100.04	100,040,800	3.4
22	社債券	日本	第34回株式会社日本政策金融公庫 社債(一般担保付)	0.295	2018/5/8	100,000,000	100.03	100,031,852	100.03	100,031,852	3.4
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	100,005,284	100.00	100,005,284	3.4

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	30.4
特殊債券	10.1
社債券	41.8
合計	82.2

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】

1. 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)

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計算期間末	(平成29年 2月20日)	88	94	1.0216	1.1016
第2計算期間末	(平成29年 8月21日)	356	356	1.0152	1.0152
第3計算期間末	(平成30年 2月20日)	434	434	0.9823	0.9823
	平成29年 3月末日	178		1.0307	
	4月末日	207		1.0366	
	5月末日	257		1.0547	
	6月末日	302		1.0530	
	7月末日	340		1.0417	
	8月末日	363		1.0271	
	9月末日	410		1.0468	
	10月末日	442		1.0303	
	11月末日	457		1.0409	
	12月末日	460		1.0741	
	平成30年 1月末日	452		1.0459	
	2月末日	434		0.9814	
	3月末日	421		0.9640	

2. 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)

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計算期間末	(平成29年 2月20日)	64	65	1.0030	1.0180
第2計算期間末	(平成29年 8月21日)	130	130	0.9980	0.9980
第3計算期間末	(平成30年 2月20日)	120	120	0.9625	0.9625
	平成29年 3月末日	76		1.0212	
	4月末日	86		1.0227	
	5月末日	109		1.0350	
	6月末日	121		1.0110	
	7月末日	125		1.0037	
	8月末日	130		0.9942	
	9月末日	130		0.9889	
	10月末日	129		0.9771	
	11月末日	121		0.9920	
	12月末日	126		1.0116	
	平成30年 1月末日	124		0.9995	
	2月末日	119		0.9553	
	3月末日	118		0.9479	

【分配の推移】

1. 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)

期	計算期間	1万口当たりの分配金(円)
---	------	---------------

第1期	平成28年 9月16日～平成29年 2月20日	800
第2期	平成29年 2月21日～平成29年 8月21日	0
第3期	平成29年 8月22日～平成30年 2月20日	0

2. 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)

期	計算期間	1万口当たりの分配金(円)
第1期	平成28年 9月16日～平成29年 2月20日	150
第2期	平成29年 2月21日～平成29年 8月21日	0
第3期	平成29年 8月22日～平成30年 2月20日	0

【収益率の推移】

1. 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)

期	計算期間	収益率(%)
第1期	平成28年 9月16日～平成29年 2月20日	10.2
第2期	平成29年 2月21日～平成29年 8月21日	0.6
第3期	平成29年 8月22日～平成30年 2月20日	3.2

注:各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配落)に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(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。

2. 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)

期	計算期間	収益率(%)
第1期	平成28年 9月16日～平成29年 2月20日	1.8
第2期	平成29年 2月21日～平成29年 8月21日	0.5
第3期	平成29年 8月22日～平成30年 2月20日	3.6

注:各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配落)に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(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】

1. 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)

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	平成28年 9月16日～平成29年 2月20日	87,257,515	1,098,245
第2期	平成29年 2月21日～平成29年 8月21日	294,704,182	29,485,602
第3期	平成29年 8月22日～平成30年 2月20日	118,303,992	26,873,697

注:第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

2. 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)

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	平成28年 9月16日～平成29年 2月20日	65,397,254	1,000,000
第2期	平成29年 2月21日～平成29年 8月21日	78,178,620	11,754,424
第3期	平成29年 8月22日～平成30年 2月20日	6,552,325	12,051,547

注:第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

LIFE UP

運用実績

※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。
※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

基準日: 2018年3月30日現在

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)

分配の推移

決算期	分配金
第1期(2017/2/20)	800円
第2期(2017/8/21)	0円
第3期(2018/2/20)	0円
設定来累計	800円

※分配金は1万口当たり、税引き前です。

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たりです。
※分配金再投資基準価額とは、税引き前の分配金を再投資したと仮定して算出した基準価額をいいます。

主要な資産の状況

投資状況

資産の種類	投資比率(%)
NN(L)フード・アンド・ビバレッジ ・年2回分配シェアクラスI (円建て)投資証券	99.0
NN短期債券マザーファンド受益証券	0.0
現金等	1.0
合計	100.0

年間収益率の推移



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)

分配の推移

決算期	分配金
第1期(2017/2/20)	150円
第2期(2017/8/21)	0円
第3期(2018/2/20)	0円
設定来累計	150円

※分配金は1万口当たり、税引き前です。

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たりです。
※分配金再投資基準価額とは、税引き前の分配金を再投資したと仮定して算出した基準価額をいいます。

主要な資産の状況

投資状況

資産の種類	投資比率(%)
NN(L)フード・アンド・ビバレッジ ・年2回分配シェアクラスI (円ヘッジ)投資証券	98.9
NN短期債券マザーファンド受益証券	0.0
現金等	1.1
合計	100.0

年間収益率の推移



※2016年は設定日(9月16日)から年末まで、2018年は3月末までの収益率です。
※税引き前の分配金を再投資したと仮定して収益率を算出しています。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。

〈投資対象とする投資信託証券の資産の状況〉

※下記データは過去のものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。また、下記は参考情報であり、特定の有価証券についての投資の勧誘あるいは投資の助言を意図するものではありません。

NN(L)フード・アンド・ビバレッジ - 年2回分配シェア クラス I (円建て) NN(L)フード・アンド・ビバレッジ - 年2回分配シェア クラス I (円ヘッジ)

基準日: 2018年3月29日現在

資産構成比率

資産の種類	投資比率(%)
株式等	99.6
現金等	0.4
合計	100.0

国別上位投資比率

順位	国名	投資比率(%)
1	米国	49.4
2	オランダ	11.4
3	英国	9.5
4	日本	8.1
5	スイス	7.6

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	国名	産業	投資比率(%)
1	プロクター・アンド・ギャンブル	米国	家庭用品	7.9
2	ユニリーバ	オランダ	パーソナル用品	7.9
3	ペプシコ	米国	飲料	7.0
4	アルトリア・グループ	米国	たばこ	6.2
5	ネスレ	スイス	食品	4.9
6	ディアジオ	英国	飲料	4.6
7	コンステレーション・ブランズ	米国	飲料	3.8
8	キリン・ホールディングス	日本	飲料	3.8
9	アホルド・デレーズ	オランダ	生薬製剤	3.5
10	スウェディッシュ・マッチ	スウェーデン	たばこ	3.4

※資産構成比率以外の投資比率は株式等に対する評価額の割合で算出しています。

※ [NN(L)フード・アンド・ビバレッジ - 年2回分配シェア クラス I (円建て)], [NN(L)フード・アンド・ビバレッジ - 年2回分配シェア クラス I (円ヘッジ)] をシェアクラスとして含む [NN(L)フード・アンド・ビバレッジ] の投資状況です。

※投資比率の単位未満を四捨五入しているため、合計が100.0%にならない場合があります。

NN短期債券マザーファンド

基準日: 2018年3月30日現在

資産構成比率

資産の種類	投資比率(%)
社債券	41.8
地方債証券	30.4
特殊債券	10.1
現金等	17.7
合計	100.0

組入上位10銘柄

順位	種類	国・地域名	銘柄名	投資比率(%)
1	地方債証券	日本	平成25年度第2回静岡県公募公債(5年)	6.7
2	社債券	日本	第22回国際協力機構債券	4.6
3	社債券	日本	第24回都市再生債券	3.4
4	社債券	日本	第469回関西電力株式会社社債(一般担保付)	3.4
5	社債券	日本	第21回一般担保住宅金融支援機構債券	3.4
6	地方債証券	日本	平成20年度第7回北海道公募公債	3.4
7	社債券	日本	第17回株式会社豊田自動織機無担保社債	3.4
8	社債券	日本	第357回中国電力株式会社社債(一般担保付)	3.4
9	地方債証券	日本	第662回東京都公募公債	3.4
10	社債券	日本	第17回独立行政法人福祉医療機構債券	3.4

※投資比率は純資産総額に対する各資産の投資割合です。

※投資比率の単位未満を四捨五入しているため、合計が100.0%にならない場合があります。

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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成29年8月22日から平成30年2月20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）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期計算期間末 (平成29年 8月21日現在)	第3期計算期間末 (平成30年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	13,637,661	8,244,339
投資証券	347,673,837	430,144,249
親投資信託受益証券	8,997	8,995
未収入金	6,000,000	-
流動資産合計	367,320,495	438,397,583
資産合計	367,320,495	438,397,583
負債の部		
流動負債		
未払金	2,000,000	1,000,000
未払解約金	7,274,726	-
未払受託者報酬	39,099	70,863
未払委託者報酬	1,225,073	2,220,328
その他未払費用	65,639	118,386
流動負債合計	10,604,537	3,409,577
負債合計	10,604,537	3,409,577
純資産の部		
元本等		
元本	351,377,850	442,808,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,338,108	7,820,139
（分配準備積立金）	1,806,611	1,697,657
元本等合計	356,715,958	434,988,006
純資産合計	356,715,958	434,988,006
負債純資産合計	367,320,495	438,397,583

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期計算期間		第3期計算期間	
	自 平成29年 2月21日	至 平成29年 8月21日	自 平成29年 8月22日	至 平成30年 2月20日
営業収益				
受取配当金		3,181,305		1,385,502
有価証券売買等損益		9,750,719		15,915,092
営業収益合計		6,569,414		14,529,590
営業費用				
受託者報酬		39,099		70,863
委託者報酬		1,225,073		2,220,328
その他費用		69,185		121,555
営業費用合計		1,333,357		2,412,746
営業利益又は営業損失（ ）		7,902,771		16,942,336
経常利益又は経常損失（ ）		7,902,771		16,942,336
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,902,771		16,942,336
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（ ）		627,243		1,020,445
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,859,445		5,338,108
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,983,472		5,372,262
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		12,983,472		5,372,262
剰余金減少額又は欠損金増加額		974,795		567,728
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		974,795		567,728
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		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,338,108		7,820,139

(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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 当ファンドの計算期間は、前期末が休日のため、平成29年 8月22日から平成30年 2月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第2期計算期間末 (平成29年 8月21日現在)	第3期計算期間末 (平成30年 2月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数 351,377,850口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 442,808,145口
	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 7,820,139円
3. 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 1.0152円 (10,000口当たり純資産額) (10,152円)	3. 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 0.9823円 (10,000口当たり純資産額) (9,823円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期計算期間 自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日			第3期計算期間 自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,806,611円	費用控除後の配当等収益額	A	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	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	3,531,497円	収益調整金額	C	722,527円
分配準備積立金額	D	0円	分配準備積立金額	D	1,697,657円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,338,108円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,420,184円
当ファンドの期末残存口数	F	351,377,850口	当ファンドの期末残存口数	F	442,808,145口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	151円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	54円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0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

第2期計算期間 自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	第3期計算期間 自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては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>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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</p> <p>同左</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

第2期計算期間末 (平成29年 8月21日現在)	第3期計算期間末 (平成30年 2月20日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額</p> <p>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ん。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額</p> <p>同左</p>

<p>2.時価の算定方法</p> <p>投資証券 (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。</p> <p>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。</p> <p>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>2.時価の算定方法</p> <p>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	第2期計算期間 自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	第3期計算期間 自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	10,163,357	16,755,898
親投資信託受益証券	2	2
合計	10,163,359	16,755,900

(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)

第2期計算期間 自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	第3期計算期間 自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

元本の移動

	第2期計算期間 自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	第3期計算期間 自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
期首元本額	86,159,270円	351,377,850円
期中追加設定元本額	294,704,182円	118,303,992円
期中一部解約元本額	29,485,602円	26,873,697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
----	----	----	--------	----

投資証券	NN(L)フード・アンド・ビパレッジ 年2回 分配シェア クラスI(円建て)	40,317.204	430,144,249	
投資証券 小計		40,317.204	430,144,249	
親投資信託受 益証券	NN短期債券マザーファンド	8,583	8,995	
親投資信託受益証券 小計		8,583	8,995	
	合計	48,900.204	430,153,244	

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。

【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）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期計算期間末 (平成29年 8月21日現在)	第3期計算期間末 (平成30年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,715,401	2,836,214
投資証券	128,378,944	119,573,388
親投資信託受益証券	8,997	8,995
流動資産合計	133,103,342	122,418,597
資産合計	133,103,342	122,418,597
負債の部		
流動負債		
未払金	2,000,000	1,000,000
未払解約金	-	90,581
未払受託者報酬	15,961	20,647
未払委託者報酬	499,931	646,783
その他未払費用	26,689	34,417
流動負債合計	2,542,581	1,792,428
負債合計	2,542,581	1,792,428
純資産の部		
元本等		
元本	130,821,450	125,322,228
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	260,689	4,696,059
（分配準備積立金）	2,291,097	2,083,331
元本等合計	130,560,761	120,626,169
純資産合計	130,560,761	120,626,169
負債純資産合計	133,103,342	122,418,597

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期計算期間		第3期計算期間	
	自 平成29年 2月21日	至 平成29年 8月21日	自 平成29年 8月22日	至 平成30年 2月20日
営業収益				
受取配当金		1,185,909		376,701
有価証券売買等損益		2,604,386		4,182,259
営業収益合計		1,418,477		3,805,558
営業費用				
受託者報酬		15,961		20,647
委託者報酬		499,931		646,783
その他費用		27,816		35,055
営業費用合計		543,708		702,485
営業利益又は営業損失（ ）		1,962,185		4,508,043
経常利益又は経常損失（ ）		1,962,185		4,508,043
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,962,185		4,508,043
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（ ）		125,071		78,625
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		193,907		260,689
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,753,538		23,816
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		23,816
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,753,538		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		120,878		29,768
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		120,878		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		29,768
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		260,689		4,696,059

(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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 当ファンドの計算期間は、前期末が休日のため、平成29年 8月22日から平成30年 2月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第2期計算期間末 (平成29年 8月21日現在)	第3期計算期間末 (平成30年 2月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数 130,821,450口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 125,322,228口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 260,689円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 4,696,059円
3. 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 0.9980円 (10,000口当たり純資産額) (9,980円)	3. 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 0.9625円 (10,000口当たり純資産額) (9,625円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期計算期間 自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	第3期計算期間 自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日																																																												
分配金の計算過程 <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>642,240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>2,173,196円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,648,857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>4,464,293円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>130,821,450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>341円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	642,240円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	2,173,196円	分配準備積立金額	D	1,648,857円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,464,293円	当ファンドの期末残存口数	F	130,821,450口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	341円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	分配金の計算過程 <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>0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>2,193,312円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,083,331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>4,276,643円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>125,322,228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>341円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	2,193,312円	分配準備積立金額	D	2,083,331円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,276,643円	当ファンドの期末残存口数	F	125,322,228口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	341円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	642,240円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	2,173,196円																																																											
分配準備積立金額	D	1,648,857円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,464,293円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	130,821,450口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	341円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	0円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	2,193,312円																																																											
分配準備積立金額	D	2,083,331円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,276,643円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	125,322,228口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	341円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

第2期計算期間 自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	第3期計算期間 自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては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>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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</p> <p>同左</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

第2期計算期間末 (平成29年 8月21日現在)	第3期計算期間末 (平成30年 2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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ん。	同左
2.時価の算定方法	2.時価の算定方法
投資証券	同左
(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。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	第2期計算期間	第3期計算期間
	自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	2,753,628	3,997,562
親投資信託受益証券	2	2
合計	2,753,630	3,997,564

(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)

第2期計算期間	第3期計算期間
自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

元本の移動

第2期計算期間	第3期計算期間
自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月21日	自 平成29年 8月22日 至 平成30年 2月20日
期首元本額	期首元本額
64,397,254円	130,821,450円
期中追加設定元本額	期中追加設定元本額
78,178,620円	6,552,325円
期中一部解約元本額	期中一部解約元本額
11,754,424円	12,051,547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
投資証券	NN(L)フード・アンド・ビバレッジ 年2回分配シェア クラスI (円ヘッジ)	12,186.444	119,573,388	
投資証券 小計		12,186.444	119,573,388	
親投資信託受益証券	NN短期債券マザーファンド	8,583	8,995	
親投資信託受益証券 小計		8,583	8,995	
	合計	20,769.444	119,582,383	

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)

「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)」および「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)」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 2月20日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	801,326,121
地方債証券	801,471,903
特殊債券	100,004,360
社債券	1,441,024,287
未収利息	1,815,355
前払費用	3,761,226
流動資産合計	3,149,403,252
資産合計	3,149,403,252
負債の部	
流動負債	
未払金	201,181,000
その他未払費用	30,250
流動負債合計	201,211,250
負債合計	201,211,250
純資産の部	
元本等	
元本	2,812,784,037
剰余金	
剰余金又は欠損金()	135,407,965

元本等合計	2,948,192,002
純資産合計	2,948,192,002
負債純資産合計	3,149,403,252

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 2月20日現在）	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,812,784,037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 2月20日現在）	
子ファンドの期首	平成29年 8月22日
期首元本額	2,295,016,402円
対象期間中の追加設定元本額	707,616,535円
対象期間中の一部解約元本額	189,848,900円
期末元本額	2,812,784,037円
平成30年 2月20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）	94,538,445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）	33,067,070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）	31,649,059円
NNマネープールVA（適格機関投資家専用）	2,632,071,397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	100,969,892	
		平成24年度第15回北海道公募公債(5年)	100,000,000	100,012,264	
		第8回3号宮城県公募公債(5年)	100,000,000	100,013,122	
		第56回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,023,136	
		第99回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,173,770	
		平成25年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	100,068,464	
		第462回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,107,245	
		平成25年度第2回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	100,104,010	
	小計	銘柄数: 8 組入時価比率: 27.19%	800,000,000	801,471,903 34.21%	
合計			801,471,903		
特殊債券	日本円	い第753号農林債	100,000,000	100,004,360	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 3.39%	100,000,000	100,004,360 4.27%	
	合計			100,004,360	

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	100,548,208	
		第3回地方公共団体金融機構債券（2年）	100,000,000	100,000,995	
		第34回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	100,062,784	
		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	100,006,766	
		第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,097,932	
		第22回国際協力機構債券	135,500,000	135,798,929	
		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	100,996,301	
		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	100,174,196	
		第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,011,250	
		第469回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,144,118	
		第357回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,977,868	
		第279回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,003,940	
		第420回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,133,940	
		第9回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,067,060	
	小計	銘柄数：14 組入時価比率：48.88%	1,435,500,000	1,441,024,287 61.52%	
合計			1,441,024,287		
合計			2,342,500,550		

(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】

【純資産額計算書】平成30年3月30日

1. 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)

資産総額	427,238,870円
負債総額	5,719,873円
純資産総額(-)	421,518,997円
発行済口数	437,260,484口
1口当たり純資産額(/)	0.9640円
(1万口当たり純資産額)	(9,640円)

2. 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)

資産総額	119,399,794円
負債総額	1,201,146円
純資産総額(-)	118,198,648円
発行済口数	124,699,438口
1口当たり純資産額(/)	0.9479円
(1万口当たり純資産額)	(9,479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	2,972,320,801円
負債総額	45,838円
純資産総額(-)	2,972,274,963円
発行済口数	2,835,911,596口
1口当たり純資産額(/)	1.0481円
(1万口当たり純資産額)	(10,481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9月末現在)

< 訂正後 >

(1) 資本金の額(平成30年3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3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	218,308
合計	38	218,308

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	第18期 (平成29年3月31日)			第19期 (平成29年12月31日)			
	科目	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)			
	科目	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		

函書費	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						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		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	
		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						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		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	
		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
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な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
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 (調整)	30.9	法定実効税率 (調整)	30.9
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	-	その他	0.1
金資産の減額修正	-	税効果会計適用後の法人税 等の負担率	40.1
その他	0.6		
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
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。		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。	
(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。		(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。	
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3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3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SBI証券	48,323百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
浜銀TT証券株式会社	3,307百万円	
西日本シティTT証券株式会社	3,000百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	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。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	

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3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4月13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）の平成29年8月22日から平成30年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の平成30年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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4月13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）の平成29年8月22日から平成30年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の平成30年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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。