

【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23年6月10日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	CEO兼執行役会長 岩崎 俊博
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁 連絡場所 東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【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】	ノムラ日本株戦略ファンド (ファンドの愛称を「Big Project - N」とします。)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額(平成22年12月11日から平成23年12月9日まで) 2兆円を上限とします。 *なお、継続申込期間(以下「申込期間」といいます。)は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新され 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】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成22年12月10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。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また 第一部 証券情報、第二部 ファンド情報、第三部 委託会社等の情報 に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

第一部【証券情報】

原届出書の 第一部 証券情報 を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

なお、当初元本は1口当り1円です。

格付けは取得していません。

(以下 略)

<訂正後>

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

なお、当初元本は1口当り1円です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(以下 略)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(3) ファンドの仕組み

(図 省略)

委託会社の概況

委託会社

(中略)

・ 資本金の額

平成22年10月末現在、17,180百万円

(中略)

・ 大株主の状況(平成22年10月末現在)

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

< 訂正後 >

(3) ファンドの仕組み

(図 省略)

委託会社の概況

委託会社

(中略)

・ 資本金の額

平成23年4月末現在、17,180百万円

(中略)

・ 大株主の状況(平成23年4月末現在)

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

2 投資方針

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(3) 運用体制

ファンドの運用体制は以下の通りです。

(中略)

ファンドの運用体制等は平成22年12月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

(3) 運用体制

ファンドの運用体制は以下の通りです。

(中略)

ファンドの運用体制等は平成23年6月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3 投資リスク

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(前略)

その他の留意点

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

（中略）

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

委託会社におけるリスクマネジメント体制

（中略）

投資リスクに関する管理体制等は平成22年12月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

（前略）

その他の留意点

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

（中略）

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの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唆するものではありません。

投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

委託会社におけるリスクマネジメント体制

（中略）

投資リスクに関する管理体制等は平成23年6月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

5 運用状況

原届出書の 第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

以下は平成23年4月28日現在の運用状況であります。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	96,555,400,465	99.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		373,399,139	0.38
合計(純資産総額)		96,928,799,604	100.00

<ご参考>

「ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	127,566,844,730	96.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,238,741,713	3.21
合計(純資産総額)		131,805,586,443	100.00

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。評価にあたっては取引所の発表する清算値段を用いております。

名称	取引所	種類	買建 /売建	通貨	枚数	簿価	評価額 (時価)	投資比率 (%)
TOPIX先物(2011年6月限)	東京証券取引所	株価指数先物	買建	円	221	1,906,125,000	1,886,235,000	1.43

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資信託受益証券	ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド	85,568,415,868	1.1201	95,845,182,614	1.1284	96,555,400,465	99.61

<ご参考>

「ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド」

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,165,500	3,139.21	3,658,759,615	3,190.00	3,717,945,000	2.82
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,457,300	2,600.00	3,788,980,000	2,260.00	3,293,498,000	2.49
3	日本	株式	三井物産	卸売業	2,110,400	1,411.00	2,977,774,400	1,432.00	3,022,092,800	2.29
4	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	920,100	3,345.00	3,077,734,500	3,230.00	2,971,923,000	2.25
5	日本	株式	三菱電機	電気機器	3,264,000	943.00	3,077,952,000	891.00	2,908,224,000	2.20
6	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,262,600	2,201.00	2,778,982,600	2,179.00	2,751,205,400	2.08
7	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,085,000	2,703.63	2,933,443,550	2,495.00	2,707,075,000	2.05
8	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	722,500	3,777.85	2,729,496,625	3,745.00	2,705,762,500	2.05
9	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	17,896	147,200.00	2,634,291,200	149,300.00	2,671,872,800	2.02
10	日本	株式	日立製作所	電気機器	5,938,000	428.87	2,546,668,157	438.00	2,600,844,000	1.97
11	日本	株式	オリックス	その他金融業	305,400	8,360.00	2,553,144,000	7,910.00	2,415,714,000	1.83
12	日本	株式	小松製作所	機械	761,400	2,631.00	2,003,243,400	2,840.00	2,162,376,000	1.64
13	日本	株式	三菱瓦斯化学	化学	3,383,000	580.00	1,962,140,000	629.00	2,127,907,000	1.61
14	日本	株式	ユニ・チャーム	化学	651,800	3,040.00	1,981,472,000	3,210.00	2,092,278,000	1.58
15	日本	株式	ファナック	電気機器	154,000	12,150.00	1,871,100,000	13,450.00	2,071,300,000	1.57
16	日本	株式	住友金属鉱山	非鉄金属	1,397,000	1,376.41	1,922,853,634	1,437.00	2,007,489,000	1.52
17	日本	株式	任天堂	その他製品	89,000	22,490.00	2,001,610,000	19,170.00	1,706,130,000	1.29
18	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	1,489,700	1,121.00	1,669,953,700	1,121.00	1,669,953,700	1.26
19	日本	株式	住友不動産	不動産業	999,000	1,774.41	1,772,642,138	1,661.00	1,659,339,000	1.25
20	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	805,000	2,047.41	1,648,169,115	2,023.00	1,628,515,000	1.23
21	日本	株式	テルモ	精密機器	352,800	4,280.00	1,509,984,000	4,500.00	1,587,600,000	1.20
22	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	862,000	1,730.00	1,491,260,000	1,770.00	1,525,740,000	1.15
23	日本	株式	味の素	食料品	1,583,000	856.00	1,355,048,000	893.00	1,413,619,000	1.07
24	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3,635,900	404.21	1,469,672,274	387.00	1,407,093,300	1.06
25	日本	株式	楽天	サービス業	18,773	74,200.00	1,392,956,600	74,600.00	1,400,465,800	1.06
26	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	418,000	3,010.00	1,258,180,000	3,090.00	1,291,620,000	0.97
27	日本	株式	デンソー	輸送用機器	475,600	2,664.27	1,267,126,812	2,706.00	1,286,973,600	0.97
28	日本	株式	キーエンス	電気機器	57,600	20,970.00	1,207,872,000	21,160.00	1,218,816,000	0.92
29	日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	3,554,000	326.00	1,158,604,000	333.00	1,183,482,000	0.89
30	日本	株式	いすゞ自動車	輸送用機器	3,375,000	338.95	1,143,967,639	346.00	1,167,750,000	0.88

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
投資信託受益証券		99.61
合計		99.61

<ご参考>

「ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド」

種類	業種	投資比率(%)
株式	鉱業	0.18
	建設業	0.37
	食料品	2.08
	繊維製品	0.21
	パルプ・紙	0.40
	化学	10.16
	医薬品	2.07
	石油・石炭製品	0.69
	ゴム製品	1.65
	ガラス・土石製品	0.65
	鉄鋼	1.28
	非鉄金属	3.12
	金属製品	1.57
	機械	6.28
	電気機器	16.76
	輸送用機器	10.36
	精密機器	1.72
	その他製品	1.69
	陸運業	2.06
	海運業	0.39
	倉庫・運輸関連業	0.59
	情報・通信業	6.92
	卸売業	6.63
	小売業	5.61
	銀行業	4.67
	証券、商品先物取引業	0.48
	保険業	1.47
その他金融業	2.47	
不動産業	1.96	
サービス業	2.15	
	小計	96.78
合計		96.78

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。

<ご参考>

「ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド」

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。評価にあたっては取引所の発表する清算値段を用いております。

名称	取引所	種類	買建 / 売建	通貨	枚数	簿価	評価額 (時価)	投資比率 (%)
TOPIX先物(2011年6月限)	東京証券取引所	株価指数先物	買建	円	221	1,906,125,000	1,886,235,000	1.43

(3)運用実績

純資産の推移

平成23年4月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間	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3期 (2001年9月20日)	560,800	560,800	0.5079	0.5079
第4期 (2002年3月20日)	554,518	554,518	0.5512	0.5512
第5期 (2002年9月20日)	432,327	432,327	0.4592	0.4592
第6期 (2003年3月20日)	356,477	356,477	0.4026	0.4026
第7期 (2003年9月22日)	398,584	398,584	0.5076	0.5076
第8期 (2004年3月22日)	394,972	394,972	0.5590	0.5590
第9期 (2004年9月21日)	373,079	373,079	0.5700	0.5700
第10期 (2005年3月22日)	357,940	357,940	0.6042	0.6042
第11期 (2005年9月20日)	360,719	360,719	0.6919	0.6919
第12期 (2006年3月20日)	428,705	428,705	0.8801	0.8801
第13期 (2006年9月20日)	371,636	371,636	0.8138	0.8138
第14期 (2007年3月20日)	343,767	343,767	0.8729	0.8729
第15期 (2007年9月20日)	281,471	281,471	0.8256	0.8256
第16期 (2008年3月21日)	196,443	196,443	0.6254	0.6254
第17期 (2008年9月22日)	176,522	176,522	0.5943	0.5943
第18期 (2009年3月23日)	114,591	114,591	0.3962	0.3962
第19期 (2009年9月24日)	131,432	131,432	0.4945	0.4945
第20期 (2010年3月23日)	118,327	118,327	0.4982	0.4982
第21期 (2010年9月21日)	99,612	99,612	0.4515	0.4515
第22期 (2011年3月22日)	97,599	97,599	0.4732	0.4732
2010年4月末日	122,443		0.5258	
5月末日	108,027		0.4678	
6月末日	102,081		0.4466	
7月末日	102,245		0.4531	
8月末日	94,392		0.4243	
9月末日	98,887		0.4466	
10月末日	96,126		0.4398	
11月末日	100,435		0.4658	
12月末日	103,519		0.4862	
2011年1月末日	103,689		0.4930	
2月末日	106,856		0.5138	
3月末日	99,799		0.4849	
4月末日	96,928		0.4757	

分配の推移

期	1口当たりの分配金
第3期	0.0000 円
第4期	0.0000 円
第5期	0.0000 円
第6期	0.0000 円
第7期	0.0000 円
第8期	0.0000 円
第9期	0.0000 円
第10期	0.0000 円
第11期	0.0000 円
第12期	0.0000 円
第13期	0.0000 円
第14期	0.0000 円
第15期	0.0000 円
第16期	0.0000 円
第17期	0.0000 円
第18期	0.0000 円
第19期	0.0000 円
第20期	0.0000 円
第21期	0.0000 円
第22期	0.0000 円

収益率の推移

期	収益率
第3期	22.6 %
第4期	8.5 %
第5期	16.7 %
第6期	12.3 %
第7期	26.1 %
第8期	10.1 %
第9期	2.0 %
第10期	6.0 %
第11期	14.5 %
第12期	27.2 %
第13期	7.5 %
第14期	7.3 %
第15期	5.4 %
第16期	24.2 %
第17期	5.0 %
第18期	33.3 %
第19期	24.8 %
第20期	0.7 %
第21期	9.4 %
第22期	4.8 %

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額、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を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

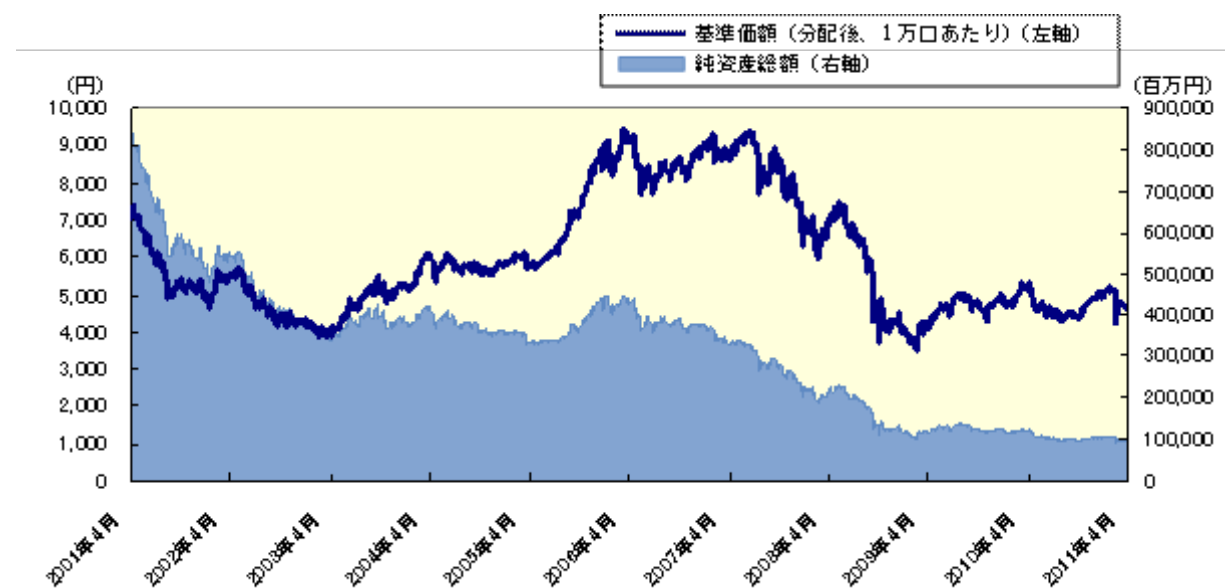
(4)設定及び解約の実績

期	設定口数	解約口数	発行済み口数
第3期	46,323,522,769	92,025,925,026	1,104,171,866,811
第4期	37,213,027,124	135,434,052,443	1,005,950,841,492
第5期	19,764,156,373	84,205,731,555	941,509,266,310
第6期	20,917,467,777	77,010,048,884	885,416,685,203
第7期	11,851,626,366	112,017,690,534	785,250,621,035
第8期	4,847,665,484	83,544,377,958	706,553,908,561
第9期	3,765,300,286	55,793,053,040	654,526,155,807
第10期	2,870,255,120	64,969,953,525	592,426,457,402
第11期	3,434,690,218	74,507,093,342	521,354,054,278
第12期	38,778,095,955	72,995,565,895	487,136,584,338
第13期	20,353,323,566	50,839,404,697	456,650,503,207
第14期	4,123,874,806	66,945,409,504	393,828,968,509
第15期	2,344,452,975	55,235,174,990	340,938,246,494
第16期	1,579,920,279	28,417,029,225	314,101,137,548
第17期	1,418,643,825	18,496,879,675	297,022,901,698
第18期	4,474,113,136	12,259,152,339	289,237,862,495
第19期	1,283,531,401	24,743,466,458	265,777,927,438
第20期	1,089,165,821	29,344,944,619	237,522,148,640
第21期	827,385,264	17,745,522,050	220,604,011,854
第22期	2,767,498,747	17,115,893,563	206,255,617,038

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

< 参考情報 > 運用実績（2011年4月28日現在）

[基準価額・純資産の推移]（日次）



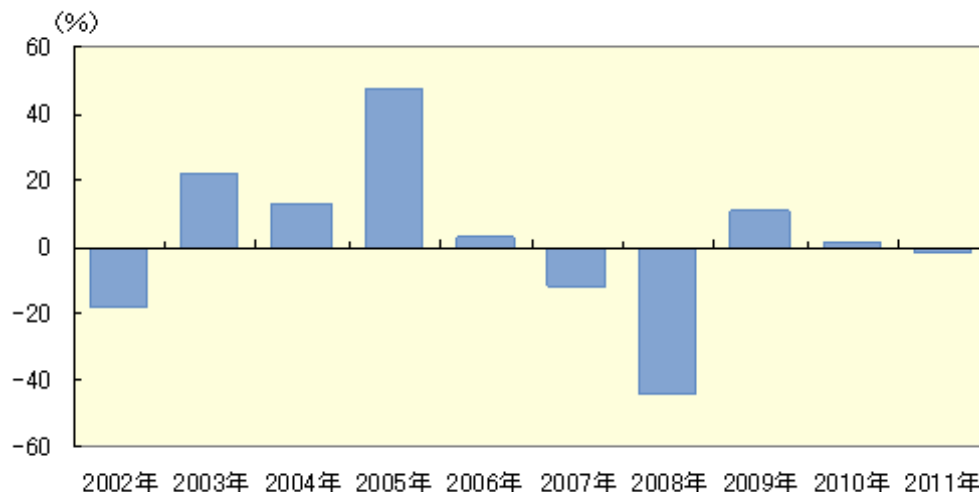
[分配の推移]（1万口あたり、課税前）

2011年3月	0 円
2010年9月	0 円
2010年3月	0 円
2009年9月	0 円
2009年3月	0 円
設定来累計	0 円

[主要な資産の状況]

実質的な銘柄別投資比率<上位>				実質的な業種別投資比率<上位>		
順位	銘柄	業種	投資比率 (%)	順位	業種	投資比率 (%)
1	本田技研工業	輸送用機器	2.8	1	電気機器	16.7
2	ソニー	電気機器	2.5	2	輸送用機器	10.3
3	三井物産	卸売業	2.3	3	化学	10.1
4	トヨタ自動車	輸送用機器	2.2	4	情報・通信業	6.9
5	三菱電機	電気機器	2.2	5	卸売業	6.6
6	三菱商事	卸売業	2.1			
7	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.0			
8	日本電信電話	情報・通信業	2.0			
9	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	2.0			
10	日立製作所	電気機器	2.0			

[年間収益率の推移]（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2011年は年初から4月末までの収益率。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

原届出書の 第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

ノムラ日本株戦略ファンド

- (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)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表等規則は、平成22年9月30日付内閣府令第45号により改正されておりますが、第21期計算期間(平成22年3月24日から平成22年9月21日まで)および第22期計算期間(平成22年9月22日から平成23年3月22日まで)については内閣府令第45号附則第3条第1項第1号により、改正前の財務諸表等規則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21期計算期間(平成22年3月24日から平成22年9月21日まで)および第22期計算期間(平成22年9月22日から平成23年3月22日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 平成22年 9月21日現在	第22期 平成23年 3月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,413,116,420	1,622,757,807
親投資信託受益証券	99,419,687,759	97,140,040,109
未収利息	4,014	4,464
流動資産合計	100,832,808,193	98,762,802,380
資産合計	100,832,808,193	98,762,802,380
負債の部		
流動負債		
未払解約金	142,553,692	143,586,645
未払受託者報酬	40,095,793	38,573,234
未払委託者報酬	1,035,898,784	979,564,396
その他未払費用	1,698,874	1,607,526
流動負債合計	1,220,247,143	1,163,331,801
負債合計	1,220,247,143	1,163,331,801
純資産の部		
元本等		
元本	220,604,011,854	206,255,617,038
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	120,991,450,804	108,656,146,459
（分配準備積立金）	5,938,344,506	6,162,971,193
元本等合計	99,612,561,050	97,599,470,579
純資産合計	99,612,561,050	97,599,470,579
負債純資産合計	100,832,808,193	98,762,802,380

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期 自平成22年 3月24日 至平成22年 9月21日	第22期 自平成22年 9月22日 至平成23年 3月22日
営業収益		
受取利息	536,626	498,834
有価証券売買等損益	9,651,626,370	5,867,530,825
営業収益合計	9,651,089,744	5,868,029,659
営業費用		
受託者報酬	40,095,793	38,573,234
委託者報酬	1,035,898,784	979,564,396
その他費用	1,698,874	1,607,526
営業費用合計	1,077,693,451	1,019,745,156
営業利益	10,728,783,195	4,848,284,503
経常利益	10,728,783,195	4,848,284,503
当期純利益	10,728,783,195	4,848,284,503
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	441,427,876	416,322,004
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	119,194,322,409	120,991,450,804
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,925,422,795	9,400,458,706
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,925,422,795	9,400,458,706
剰余金減少額又は欠損金増加額	435,195,871	1,497,116,860
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	435,195,871	1,497,116,860
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	120,991,450,804	108,656,146,459

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第21期 自 平成22年3月24日 至 平成22年9月21日	第22期 自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 親投資信託受益証券基準価額で評価しております。	(1) 親投資信託受益証券 同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 有価証券売買等損益の計上基準約定日基準で計上しております。	(1) 有価証券売買等損益の計上基準 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は前期末及び当期末が休日のため、平成22年3月24日から平成22年9月21日までとなっております。	当ファンドの計算期間は前期末及び当期末が休日のため、平成22年9月22日から平成23年3月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第21期 平成22年9月21日現在	第22期 平成23年3月22日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 220,604,011,854 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 206,255,617,038 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 120,991,450,804 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 108,656,146,459 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 0.4515 円 (10,000口当たり純資産額 4,515 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 0.4732 円 (10,000口当たり純資産額 4,732 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自 平成22年3月24日 至 平成22年9月21日	第22期 自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日
1 分配金の計算過程 該当事項はございません。	1 分配金の計算過程 該当事項はございません。

(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21期 自 平成22年3月24日 至 平成22年9月21日	第22期 自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22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、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資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金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</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 同左</p> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第21期 平成22年9月21日現在	第22期 平成23年3月22日現在
1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2 時価の算定方法 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)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第21期 自 平成22年3月24日 至 平成22年9月21日	第22期 自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第21期 自 平成22年3月24日 至 平成22年9月21日	第22期 自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日
期首元本額 237,522,148,640 円	期首元本額 220,604,011,854 円
期中追加設定元本額 827,385,264 円	期中追加設定元本額 2,767,498,747 円
期中一部解約元本額 17,745,522,050 円	期中一部解約元本額 17,115,893,563 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第21期 自 平成22年3月24日 至 平成22年9月21日	第22期 自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日
種類	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	9,223,441,983	5,359,570,108
合計	9,223,441,983	5,359,570,108

3 デリバティブ取引関係

第21期(自 平成22年3月24日 至 平成22年9月21日)

該当事項はございません。

第22期(自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日)

該当事項はございません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成23年3月22日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券 (平成23年3月22日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド		97,140,040,109	
親投資信託受益証券計	銘柄数：1		97,140,040,109	
	組入時価比率：99.5%		100%	
合計			97,140,040,109	

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

第2 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

該当事項はございません。

参考

ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド

当ファンドは「ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

尚、同親投資信託の状況は次の通りです。

1 「ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1)貸借対照表

科目	対象年月日	平成23年3月22日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,940,812,733
株式		128,444,035,250
未収入金		2,158,121,406
未収配当金		165,329,200
未収利息		10,841
差入委託証拠金		299,555,000
流動資産合計		135,007,864,430
資産合計		135,007,864,430
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		165,989,230
未払金		2,054,692,288
流動負債合計		2,220,681,518
負債合計		2,220,681,518
純資産の部		
元本等		
元本		118,548,216,331
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		14,238,966,581
元本等合計		132,787,182,912
純資産合計		132,787,182,912
負債純資産合計		135,007,864,430

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価額のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 (2) 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益の計上基準 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23年3月22日現在	
1 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	1,1201 円
(10,000口当たり純資産額)	11,201 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

自 平成22年9月22日 至 平成23年3月22日	
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、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(3)附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。
4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月22日現在	
1 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 時価の算定方法	株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(3)附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(その他の注記)

平成23年3月22日現在	
1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成22年9月22日
期首元本額	126,516,115,121 円
期首より平成23年3月22日までの期中追加設定元本額	1,715,041,388 円
期首より平成23年3月22日までの期中一部解約元本額	9,682,940,178 円
期末元本額	118,548,216,331 円
期末元本額の内訳*	
ノムラ日本株戦略ファンド	86,724,435,416 円
ノムラ日本株戦略ファンド(野村SMA向け)	579,570,902 円
ノムラ日本株戦略ファンドVA(適格機関投資家専用)	28,094,757,115 円
ノムラ日本株戦略ファンド(確定拠出年金向け)	3,149,452,898 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

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(平成23年3月22日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	国際石油開発帝石	204	600,000.00	122,400,000	
	石油資源開発	28,800	4,020.00	115,776,000	
	ミライト・ホールディングス	178,400	620.00	110,608,000	
	長谷工コーポレーション	1,193,000	66.00	78,738,000	
	三井ホーム	126,000	440.00	55,440,000	
	きんでん	143,000	713.00	101,959,000	
	中外炉工業	180,000	358.00	64,440,000	
	太平電業	134,000	560.00	75,040,000	
	高砂熱学工業	182,500	714.00	130,305,000	
	山崎製パン	99,000	933.00	92,367,000	
	S Foods	94,000	677.00	63,638,000	
	キリンホールディングス	242,000	1,082.00	261,844,000	
	日清オイリオグループ	532,000	415.00	220,780,000	
	不二製油	389,200	1,108.00	431,233,600	
	味の素	1,583,000	856.00	1,355,048,000	
	わらべや日洋	138,800	1,051.00	145,878,800	
	日清紡ホールディングス	125,000	755.00	94,375,000	
	東レ	304,000	584.00	177,536,000	
	王子製紙	1,461,000	362.00	528,882,000	
	クラレ	633,100	1,031.00	652,726,100	
	旭化成	225,000	546.00	122,850,000	
	昭和電工	3,126,000	164.00	512,664,000	
	住友化学	1,332,000	396.00	527,472,000	
	信越化学工業	247,300	4,140.00	1,023,822,000	
	堺化学工業	289,000	389.00	112,421,000	
	大陽日酸	1,756,000	659.00	1,157,204,000	
	四国化成工業	262,000	519.00	135,978,000	
	日本触媒	486,000	891.00	433,026,000	
	カネカ	53,000	570.00	30,210,000	
	三菱瓦斯化学	3,425,000	580.00	1,986,500,000	
	J S R	176,000	1,644.00	289,344,000	
	ダイセル化学工業	1,260,000	486.00	612,360,000	
	宇部興産	3,193,000	254.00	811,022,000	
	日立化成工業	160,900	1,699.00	273,369,100	
	扶桑化学工業	26,700	2,267.00	60,528,900	

	A D E K A	280,100	730.00	204,473,000	
	三洋化成工業	90,000	614.00	55,260,000	
	太陽ホールディングス	37,700	2,661.00	100,319,700	
	東洋インキ製造	135,000	405.00	54,675,000	
	富士フイルムホールディングス	331,200	2,542.00	841,910,400	
	ドクターシーラボ	606	312,000.00	189,072,000	
	上村工業	51,400	3,745.00	192,493,000	
	荒川化学工業	146,800	780.00	114,504,000	
	日東電工	31,300	4,480.00	140,224,000	
	レック	88,700	1,284.00	113,890,800	
	エフピコ	36,000	4,225.00	152,100,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	ニフコ	58,600	2,050.00	120,130,000	
	ユニ・チャーム	651,800	3,040.00	1,981,472,000	
	協和発酵キリン	514,000	746.00	383,444,000	
	アステラス製薬	418,000	3,010.00	1,258,180,000	
	中外製薬	387,600	1,415.00	548,454,000	
	科研製薬	135,000	978.00	132,030,000	
	大正製薬	85,000	1,730.00	147,050,000	
	鳥居薬品	81,900	1,596.00	130,712,400	
	第一三共	62,800	1,585.00	99,538,000	
	J Xホールディングス	1,619,000	576.00	932,544,000	
	プリヂストン	862,000	1,730.00	1,491,260,000	
	住友ゴム工業	626,300	837.00	524,213,100	
	ニッタ	63,700	1,506.00	95,932,200	
	旭硝子	111,000	1,051.00	116,661,000	
	日本板硝子	535,000	227.00	121,445,000	
	住友大阪セメント	333,000	250.00	83,250,000	
	東海カーボン	249,000	400.00	99,600,000	
	S E Cカーボン	138,000	430.00	59,340,000	
	T O T O	404,000	673.00	271,892,000	
	日本碍子	68,000	1,373.00	93,364,000	
	新日本製鐵	394,000	271.00	106,774,000	
	住友金属工業	1,200,000	180.00	216,000,000	
	神戸製鋼所	1,327,000	213.00	282,651,000	
	ジェイ エフ イー ホールディ ングス	36,600	2,489.00	91,097,400	
	大和工業	23,100	2,641.00	61,007,100	
	大阪製鐵	253,900	1,431.00	363,330,900	
	住友鋼管	300,400	618.00	185,647,200	
	中部鋼鈹	334,400	506.00	169,206,400	
	大同特殊鋼	218,000	469.00	102,242,000	
	山陽特殊製鋼	134,000	435.00	58,290,000	
	日立金属	126,000	1,060.00	133,560,000	
	住友金属鉱山	1,293,000	1,374.00	1,776,582,000	
	D O W Aホールディングス	587,000	487.00	285,869,000	
	住友電気工業	1,489,700	1,121.00	1,669,953,700	
	コロナ	41,700	778.00	32,442,600	
	三和ホールディングス	1,004,000	282.00	283,128,000	
	文化シャッター	653,000	213.00	139,089,000	
	住生活グループ	132,200	2,102.00	277,884,400	
	リンナイ	219,400	5,180.00	1,136,492,000	
	パイオラックス	39,700	1,905.00	75,628,500	
	日本発條	117,000	836.00	97,812,000	
	三益半導体工業	106,400	820.00	87,248,000	
	日本製鋼所	371,000	640.00	237,440,000	
	富士機械製造	65,000	2,000.00	130,000,000	
	ナブテスコ	125,300	1,970.00	246,841,000	
	三井海洋開発	172,500	1,422.00	245,295,000	
	オイレス工業	245,200	1,691.00	414,633,200	
	小松製作所	868,000	2,631.00	2,283,708,000	

クボタ	1,197,000	820.00	981,540,000
荏原製作所	269,000	423.00	113,787,000
ダイキン工業	376,800	2,476.00	932,956,800
椿本チエイン	351,000	442.00	155,142,000
ダイフク	220,000	597.00	131,340,000
マックス	99,000	1,051.00	104,049,000
グローリー	214,300	1,725.00	369,667,500
日本精工	198,000	714.00	141,372,000
マキタ	290,000	3,545.00	1,028,050,000
日立造船	2,417,500	112.00	270,760,000
三菱重工業	2,176,000	347.00	755,072,000
ミネベア	311,000	437.00	135,907,000
日立製作所	3,299,000	438.00	1,444,962,000
東芝	1,711,000	406.00	694,666,000
三菱電機	3,264,000	943.00	3,077,952,000
安川電機	456,000	944.00	430,464,000
マブチモーター	112,400	3,850.00	432,740,000
日本電産	125,600	7,200.00	904,320,000
メルコホールディングス	47,600	2,595.00	123,522,000
日本電気	2,849,000	193.00	549,857,000
富士通	1,389,000	501.00	695,889,000
沖電気工業	2,238,000	63.00	140,994,000
パナソニック	122,900	1,005.00	123,514,500

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日立国際電気	350,000	685.00	239,750,000	
	ソニー	1,457,300	2,600.00	3,788,980,000	
	T D K	175,000	4,840.00	847,000,000	
	ミツミ電機	73,600	1,053.00	77,500,800	
	アルプス電気	110,900	809.00	89,718,100	
	日本電波工業	89,500	1,266.00	113,307,000	
	山武	60,900	1,948.00	118,633,200	
	日本光電工業	115,300	1,764.00	203,389,200	
	キーエンス	57,600	20,970.00	1,207,872,000	
	スタンレー電気	73,800	1,395.00	102,951,000	
	ファナック	190,400	12,150.00	2,313,360,000	
	大真空	424,000	442.00	187,408,000	
	ローム	19,900	5,170.00	102,883,000	
	浜松ホトニクス	236,700	3,125.00	739,687,500	
	京セラ	36,500	7,820.00	285,430,000	
	太陽誘電	111,000	1,043.00	115,773,000	
	村田製作所	152,200	5,640.00	858,408,000	
	ニチコン	133,300	1,172.00	156,227,600	
	小糸製作所	533,000	1,277.00	680,641,000	
	キャノン電子	70,200	2,251.00	158,020,200	
	東京エレクトロン	137,800	4,670.00	643,526,000	
	デンソー	479,700	2,667.00	1,279,359,900	
	川崎重工業	4,243,000	326.00	1,383,218,000	
	いすゞ自動車	3,097,000	340.00	1,052,980,000	
	トヨタ自動車	920,100	3,345.00	3,077,734,500	
	日野自動車	969,000	397.00	384,693,000	
	武蔵精密工業	69,100	1,899.00	131,220,900	
	新明和工業	117,000	337.00	39,429,000	
	プレス工業	290,000	322.00	93,380,000	
	アイシン精機	345,100	2,815.00	971,456,500	
	ダイハツ工業	237,000	1,232.00	291,984,000	
	本田技研工業	1,137,200	3,145.00	3,576,494,000	
	スズキ	144,700	1,784.00	258,144,800	
	エクセディ	59,600	2,385.00	142,146,000	
	ハイレックスコーポレーション	91,900	1,385.00	127,281,500	
	愛三工業	100,000	892.00	89,200,000	
	シマノ	123,000	3,900.00	479,700,000	
	タカタ	117,200	2,420.00	283,624,000	
	テルモ	352,800	4,280.00	1,509,984,000	
	日機装	135,000	633.00	85,455,000	
	タムロン	52,300	1,780.00	93,094,000	
	朝日インテック	185,000	1,628.00	301,180,000	
	ニプロ	63,900	1,627.00	103,965,300	
	バンダイナムコホールディングス	223,300	917.00	204,766,100	
	大建工業	544,000	253.00	137,632,000	
	アシックス	113,000	1,106.00	124,978,000	
	リンテック	57,700	2,230.00	128,671,000	

任天堂	89,000	22,490.00	2,001,610,000
東京電力	171,100	1,098.00	187,867,800
電源開発	227,000	2,619.00	594,513,000
東日本旅客鉄道	177,300	4,870.00	863,451,000
ハマキョウレックス	156,400	2,414.00	377,549,600
日本通運	438,000	312.00	136,656,000
ヤマトホールディングス	633,800	1,247.00	790,348,600
福山通運	298,000	396.00	118,008,000
セイノーホールディングス	201,000	585.00	117,585,000
日立物流	116,800	1,155.00	134,904,000
日本郵船	1,571,000	328.00	515,288,000
日新	380,000	212.00	80,560,000
三菱倉庫	275,000	907.00	249,425,000
三井倉庫	359,000	305.00	109,495,000
住友倉庫	285,000	387.00	110,295,000
近鉄エクスプレス	94,900	2,440.00	231,556,000
ITホールディングス	273,500	839.00	229,466,500
フジ・メディア・ホールディングス	1,144	121,300.00	138,767,200
ヤフー	13,669	29,690.00	405,832,610
シーエーシー	205,400	667.00	137,001,800
オービックビジネスコンサルタント	60,250	4,500.00	271,125,000
伊藤忠テクノソリューションズ	66,800	2,608.00	174,214,400
日本ユニシス	436,800	543.00	237,182,400
兼松エレクトロニクス	152,700	829.00	126,588,300

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	スカパーJ S A Tホールディングス	3,497	28,920.00	101,133,240	
	日本電信電話	719,400	3,780.00	2,719,332,000	
	K D D I	1,032	510,000.00	526,320,000	
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,898	147,200.00	2,928,985,600	
	D T S	151,500	864.00	130,896,000	
	スクウェア・エニックス・ホールディングス	297,000	1,410.00	418,770,000	
	ソフトバンク	215,800	3,025.00	652,795,000	
	トシン・グループ	94,400	1,980.00	186,912,000	
	シップヘルスケアホールディングス	253,100	997.00	252,340,700	
	伯東	114,200	830.00	94,786,000	
	アズワン	51,300	1,861.00	95,469,300	
	シークス	293,400	1,130.00	331,542,000	
	伊藤忠商事	661,500	825.00	545,737,500	
	丸紅	508,000	580.00	294,640,000	
	三井物産	2,140,900	1,411.00	3,020,809,900	
	日立ハイテクノロジーズ	288,600	1,662.00	479,653,200	
	住友商事	366,600	1,142.00	418,657,200	
	三菱商事	1,282,500	2,201.00	2,822,782,500	
	阪和興業	369,000	357.00	131,733,000	
	伊藤忠エネクス	210,900	455.00	95,959,500	
	トラスコ中山	121,100	1,407.00	170,387,700	
	アスクル	149,500	1,236.00	184,782,000	
	ゲオ	668	91,700.00	61,255,600	
	ポイント	18,500	3,535.00	65,397,500	
	あみやき亭	224	263,500.00	59,024,000	
	ナフコ	85,500	1,315.00	112,432,500	
	D C Mホールディングス	199,000	464.00	92,336,000	
	ユニバース	24,900	1,193.00	29,705,700	
	三越伊勢丹ホールディングス	917,000	788.00	722,596,000	
	グローウェルホールディングス	70,700	1,946.00	137,582,200	
	クリエイトS Dホールディングス	71,600	1,822.00	130,455,200	
	ブックオフコーポレーション	296,500	603.00	178,789,500	
	あさひ	43,000	1,361.00	58,523,000	
	セブン&アイ・ホールディングス	749,300	2,048.00	1,534,566,400	
	良品計画	151,200	3,410.00	515,592,000	
	ドン・キホーテ	37,900	2,749.00	104,187,100	
	ピーシーデポコーポレーション	5,435	20,980.00	114,026,300	
	スギホールディングス	26,200	1,850.00	48,470,000	
	島忠	67,400	1,762.00	118,758,800	
	マックスバリュ東海	129,500	1,018.00	131,831,000	
オークワ	169,000	786.00	132,834,000		
コメリ	120,100	1,969.00	236,476,900		
青山商事	96,400	1,190.00	114,716,000		

松屋	184,500	478.00	88,191,000
パルコ	170,300	688.00	117,166,400
丸井グループ	210,200	572.00	120,234,400
ヤオコー	53,100	2,445.00	129,829,500
ゼビオ	320,200	1,517.00	485,743,400
アークランドサカモト	148,600	930.00	138,198,000
ニトリホールディングス	108,400	6,960.00	754,464,000
アークス	152,600	1,225.00	186,935,000
ファーストリテイリング	5,300	10,700.00	56,710,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,524,600	405.00	1,427,463,000
りそなホールディングス	356,200	395.00	140,699,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,029,000	2,715.00	2,793,735,000
千葉銀行	1,078,000	479.00	516,362,000
横浜銀行	1,736,000	394.00	683,984,000
常陽銀行	295,000	337.00	99,415,000
武蔵野銀行	65,500	2,704.00	177,112,000
静岡銀行	145,000	683.00	99,035,000
スルガ銀行	192,000	748.00	143,616,000
京都銀行	193,000	720.00	138,960,000
住友信託銀行	242,000	466.00	112,772,000
みずほフィナンシャルグループ	1,899,600	150.00	284,940,000
京葉銀行	486,000	420.00	204,120,000
大和証券グループ本社	288,000	403.00	116,064,000
みずほ証券	490,000	229.00	112,210,000
マネックスグループ	15,078	20,050.00	302,313,900
NK S Jホールディングス	213,000	536.00	114,168,000
MS & A Dインシュアランスグループ	142,200	1,852.00	263,354,400
ホールディングス			

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	ソニーフィナンシャルホールディングス	833	326,000.00	271,558,000		
	東京海上ホールディングス	462,200	2,282.00	1,054,740,400		
	T & Dホールディングス	124,600	2,100.00	261,660,000		
	芙蓉総合リース	35,000	2,461.00	86,135,000		
	日本証券金融	205,500	554.00	113,847,000		
	イオンクレジットサービス	488,500	1,126.00	550,051,000		
	オリックス	305,400	8,360.00	2,553,144,000		
	大阪証券取引所	361	444,500.00	160,464,500		
	一建設	38,600	2,283.00	88,123,800		
	パーク24	120,200	828.00	99,525,600		
	東京建物	351,000	332.00	116,532,000		
	ダイビル	156,800	666.00	104,428,800		
	東急不動産	1,404,000	379.00	532,116,000		
	住友不動産	900,000	1,798.00	1,618,200,000		
	明和地所	171,200	493.00	84,401,600		
	ミクシィ	319	353,000.00	112,607,000		
	総合警備保障	317,900	909.00	288,971,100		
	カカコム	198	471,000.00	93,258,000		
	エムスリー	189	483,000.00	91,287,000		
	ベストプライダル	1,108	72,000.00	79,776,000		
	ファンコミュニケーションズ	726	114,000.00	82,764,000		
	もしもしホットライン	99,650	1,638.00	163,226,700		
	楽天	23,286	74,200.00	1,727,821,200		
	西尾レントオール	162,400	744.00	120,825,600		
	セコム	64,300	3,915.00	251,734,500		
	ダイセキ	108,400	1,457.00	157,938,800		
	計	銘柄数：284			128,444,035,250	
		組入時価比率：96.7%			100%	
合計				128,444,035,250		

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

(2) 株式以外の有価証券(平成23年3月22日現在)
該当事項はございません。

第2 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

種類	平成23年3月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建	2,071,975,000		1,906,125,000	165,989,230
合計	2,071,975,000		1,906,125,000	165,989,230

(注)時価の算定方法

先物取引

先物取引の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2 ファンドの現況

原届出書の 第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

純資産額計算書

平成23年4月28日現在

資産総額	97,235,838,434	円
負債総額	307,038,830	円
純資産総額(-)	96,928,799,604	円
発行済口数	203,747,163,999	口
1口当たり純資産額(/)	0.4757	円

<ご参考>

「ノムラ日本株戦略ファンド マザーファンド」

資産総額	134,373,893,046	円
負債総額	2,568,306,603	円
純資産総額(-)	131,805,586,443	円
発行済口数	116,810,834,712	口
1口当たり純資産額(/)	1.1284	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

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 資本金の額

平成22年10月末現在、17,180百万円

(以下 略)

<訂正後>

(1) 資本金の額

平成23年4月末現在、17,180百万円

(以下 略)

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の 第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

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

委託者の運用する証券投資信託は平成23年3月31日現在次の通りです(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	719	10,878,900
単位型株式投資信託	23	246,494
追加型公社債投資信託	19	4,797,502
単位型公社債投資信託	0	0
合計	761	15,922,896

3 委託会社等の経理状況

[次へ](#)

第2 【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

原届出書の 第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容 につき
ましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 平成23年3月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
安藤証券株式会社	2,280百万円	
リテラ・クリア証券株式会社	3,794百万円	
岩井証券株式会社 ¹	3,000百万円	
ひろぎんウツミ屋証券株式会社	6,100百万円	
株式会社 エコ・プランニング証券	415百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	
岡三証券株式会社	5,000百万円	
岡地証券株式会社	1,500百万円	
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
木村証券株式会社	500百万円	
極東証券株式会社	5,251百万円	
黒川木徳証券株式会社	2,065百万円	
コスモ証券株式会社	13,500百万円	
S M B C フレンド証券株式会社	27,270百万円	
静岡東海証券株式会社	600百万円	
新大垣証券株式会社	175百万円	
むさし証券株式会社	5,000百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
中銀証券株式会社	2,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
新潟証券株式会社	600百万円	
西日本シティTT証券株式会社	1,575百万円	
日本アジア証券株式会社 ¹	4,000百万円	
のぞみ証券株式会社	2,091百万円	
浜銀TT証券株式会社	3,307百万円	
前田証券株式会社	2,198百万円	

丸三証券株式会社	10,000百万円	
丸八証券株式会社	3,676百万円	
みずほインベスターズ証券株式会社 ¹	80,288百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	3,000百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
八幡証券株式会社	1,260百万円	
豊証券株式会社	2,540百万円	
株式会社SBI証券	47,937百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社 阿波銀行	23,452百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社 大垣共立銀行	36,166百万円	
株式会社 北國銀行	26,673百万円	
株式会社 十六銀行	36,839百万円	
株式会社 きらやか銀行	17,700百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社 池田泉州銀行	50,710百万円	
株式会社 筑邦銀行	8,000百万円	
株式会社 東北銀行	8,233百万円	
株式会社 徳島銀行	11,036百万円	
株式会社 西日本シティ銀行	85,745百万円	
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	
株式会社 福井銀行	17,965百万円	
株式会社 福岡銀行 ¹	82,329百万円	
株式会社 北海道銀行	93,524百万円	
株式会社 みなと銀行	27,484百万円	
株式会社 宮崎太陽銀行	12,252百万円	
株式会社 武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社 山梨中央銀行	15,400百万円	
横浜信用金庫	2,035百万円 ²	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

* 平成23年3月末現在

- 1 岩井証券株式会社、日本アジア証券株式会社、みずほインベスターズ証券株式会社および株式会社 福岡銀行は、新規の募集・販売は行いません。
- 2 横浜信用金庫の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

原届出書の 第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況 の該当部分を以下のように訂正するとともに、末尾に添付のように、最近中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）の中間財務諸表（以下「中間財務諸表」といいます。）が追加されます。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(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8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

なお、財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号により改正されておりますが、第50期事業年度(前事業年度)は、内閣府令第50号改正前の財務諸表等規則に基づき作成しており、第51期事業年度(当事業年度)は、内閣府令第50号改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度及び当事業年度の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

<訂正後>

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(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8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

なお、財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号により改正されておりますが、第50期事業年度(前事業年度)は改正前、第51期事業年度(当事業年度)は改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度及び当事業年度の財務諸表ならびに当中間会計期間の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

< 中間財務諸表 >

中間貸借対照表

		平成22年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		1,452
金銭の信託		38,874
有価証券		2,300
短期貸付金		186
未収委託者報酬		10,177
未収収益		3,318
繰延税金資産		1,118
その他		260
貸倒引当金		6
流動資産計		57,681
固定資産		
有形固定資産	1	1,609
無形固定資産		11,109
ソフトウェア		11,106
その他		2
投資その他の資産		26,021
投資有価証券		8,177
関係会社株式		16,099
繰延税金資産		937
その他		807
貸倒引当金		0
固定資産計		38,740
資産合計		96,421

		平成22年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
関係会社短期借入金		10,000
未払収益分配金		4
未払償還金		60
未払手数料		4,495
その他未払金	2	1,878
未払費用		7,118
未払法人税等		669
賞与引当金		1,518
その他		93
流動負債計		25,839
固定負債		
退職給付引当金		4,520
時効後支払損引当金		482
その他		22
固定負債計		5,025
負債合計		30,865
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		63,157
資本剰余金		17,180
資本剰余金		11,729
資本準備金		11,729
利益剰余金		34,247
利益準備金		685
その他利益剰余金		33,561
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		8,955
評価・換算差額等		2,399
その他有価証券評価差額金		2,415
繰延ヘッジ損益		16
純資産合計		65,556
負債・純資産合計		96,421

中間損益計算書

		自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		39,377
運用受託報酬		5,636
その他営業収益		61
営業収益計		45,075
営業費用		
支払手数料		18,603
調査費		10,459
その他営業費用		2,321
営業費用計		31,385
一般管理費	1	12,045
営業利益		1,645
営業外収益	2	3,121
営業外費用	3	48
経常利益		4,718
特別利益	4	513
特別損失	5	155
税引前中間純利益		5,077
法人税、住民税及び事業税		1,862
法人税等調整額		527
中間純利益		2,687

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間

（単位：百万円）

	自 平成22年 4月 1日
	至 平成22年 9月30日
株主資本	
資本金	
前期末残高	17,180
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	17,180
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	11,729
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,729
資本剰余金合計	
前期末残高	11,729
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,729
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	685
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	685
その他利益剰余金	
別途積立金	
前期末残高	24,606
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	24,606
繰越利益剰余金	
前期末残高	9,872
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
当中間期変動額合計	917
当中間期末残高	8,955
利益剰余金合計	
前期末残高	35,164

当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
当中間期変動額合計	917
当中間期末残高	34,247
株主資本合計	
前期末残高	64,074
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
当中間期変動額合計	917
当中間期末残高	63,157
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	3,056
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	640
当中間期変動額合計	640
当中間期末残高	2,415
繰延ヘッジ損益	
前期末残高	175
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	192
当中間期変動額合計	192
当中間期末残高	16
評価・換算差額等合計	
前期末残高	3,231
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	832
当中間期変動額合計	832
当中間期末残高	2,399
純資産合計	
前期末残高	67,306
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	832
当中間期変動額合計	1,749
当中間期末残高	65,556

[中間財務諸表作成の基本となる重要な事項]

	自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>子会社株式及び関連会社株式... 移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの... 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの... 移動平均法による原価法</p>
2 デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	時価法
3 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
4 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年 4月 1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。</p>
5 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6 リース取引の処理方法	<p>リース取引開始日が平成20年 4月 1日より前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>

	自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日
7 ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 ヘッジ会計は、原則として、時価評価されているヘッジ手段に係る損益を、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで資産または負債として繰り延べる方法によっております。 また、為替予約が付されている外貨建金銭債権については、振当処理を行っております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段 - 為替予約 ヘッジ対象 - 投資有価証券、短期貸付金 (3) ヘッジ方針 投資有価証券及び短期貸付金に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 為替変動リスクのヘッジにつきましては、そのリスク減殺効果を、対応するヘッジ手段ならびにヘッジ対象ごとに定期的に把握し、ヘッジの有効性を確かめております。
8 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。
9 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

[中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更]

	自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日
資産除去債務に関する会計基準	当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年 3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年 3月31日）を適用しております。 これによる損益への影響はありません。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

平成22年 9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	2,221百万円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

中間損益計算書関係

自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	205百万円
無形固定資産	2,093百万円
長期前払費用	4百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	1,346百万円
金銭の信託運用益	1,554百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	38百万円
4 特別利益の内訳	
投資有価証券売却益	419百万円
株式報酬受入益	94百万円
5 特別損失の内訳	
投資有価証券売却損	149百万円
投資有価証券等評価損	6百万円

中間株主資本等変動計算書関係

自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日					
1 発行済株式に関する事項					
	株式の種類	平成22年 3月末	増加	減少	平成22年 9月末
	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株
2 配当に関する事項					
	配当金支払額				
	平成22年 5月27日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。				
	・ 普通株式の配当に関する事項				
	(1) 配当金の総額		3,605百万円		
	(2) 1株当たり配当額		700円		
	(3) 基準日		平成22年 3月31日		
	(4) 効力発生日		平成22年 6月 1日		

リース取引関係

自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日	
1 ファイナンス・リース取引	
(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) 該当事項はありません。	
(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額	
有形固定資産（器具備品）	
取得価額相当額	460百万円
減価償却累計額相当額	325
中間期末残高相当額	135
未経過リース料中間期末残高相当額	
1年内	88百万円
1年超	53
合計	141
支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額	
支払リース料	56百万円
減価償却費相当額	52
支払利息相当額	2
減価償却費相当額の算定方法	
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	
利息相当額の算定方法	
リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については利息法によっております。	
2 オペレーティング・リース取引	
未経過リース料	
1年内	7百万円
1年超	7
合計	14

金融商品関係

当中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,452	1,452	-
(2)金銭の信託	38,874	38,874	-
(3)短期貸付金	186	186	-
(4)未収委託者報酬	10,177	10,177	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	9,681	9,681	-
(6)関係会社株式	3,064	68,074	65,010
資産計	63,436	128,446	65,010
(7)関係会社短期借入金	10,000	10,000	-
(8)未払金	6,439	6,439	-
未払収益分配金	4	4	-
未払償還金	60	60	-
未払手数料	4,495	4,495	-
その他未払金	1,878	1,878	-
(9)未払費用	7,118	7,118	-
(10)未払法人税等	669	669	-
負債計	24,227	24,227	-
(11)デリバティブ取引（*）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	22	22	-
デリバティブ取引計	22	22	-

（*）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(3)短期貸付金、(4)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。ただし、短期貸付金は為替予約等の振当処理の対象とされており、円貨建債権とみて当該帳簿価額を以って時価としております。「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価格、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 関係会社短期借入金、(8) 未払金、(9) 未払費用、(10) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式（中間貸借対照表計上額：投資有価証券796百万円、関係会社株式13,035百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

有価証券関係

当中間会計期間末（平成22年9月30日）

1. 満期保有目的の債券(平成22年9月30日)

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式(平成22年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	68,074	65,010
合計	3,064	68,074	65,010

3. その他有価証券(平成22年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの			
株式	4,541	282	4,258
投資信託	1	1	0
小計	4,542	283	4,258
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託(1)	2,839	3,003	163
譲渡性預金	2,300	2,300	-
小計	5,139	5,303	163
合計	9,681	5,586	4,094

- (1) 当中間会計期間において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ利益は 16百万円（税効果会計適用後）であり、中間貸借対照表に計上しております。

デリバティブ取引関係

当中間会計期間（自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	為替予約取引	投資信託	2,809	-	22	先物為替相場によっている
為替予約等の振当処理	為替予約取引	短期貸付金	186	-	(*1) -	-
合 計			2,996	-	(*1) 22	-

(*1) 為替予約等の振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている短期貸付金と一体として処理されるため、その時価は当該短期貸付金の時価に含めて記載しております。

セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)

1．セグメント情報

当社は投資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。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

(追加情報)

当中間会計期間より「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

1 株当たり情報

自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日	
1 株当たり純資産額	12,727円70銭
1 株当たり中間純利益	521円87銭
(注) 1 . 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。	
2 . 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。	
中間純利益	2,687百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,687百万円
期中平均株式数	5,150千株

独立監査人の中間監査報告書

平成22年11月24日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	英 公 一
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀 井 純 子
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊 藤 志 保

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」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

独立監査人の監査報告書

平成22年11月4日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公 一指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

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」に掲げられているノムラ日本株戦略ファンドの平成22年3月24日から平成22年9月21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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、ノムラ日本株戦略ファンドの平成22年9月21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。

野村アセットマネジメント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、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成23年5月6日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公 一指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

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」に掲げられているノムラ日本株戦略ファンドの平成22年9月22日から平成23年3月22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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、ノムラ日本株戦略ファンドの平成23年3月22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。

野村アセットマネジメント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、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)