

【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24年6月15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23年12月10日から平成24年12月14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23年12月9日付をもって提出した有価証券届出書（平成24年3月30日提出の有価証券届出書の訂正届出書にて訂正済み、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

（前略）

委託会社の概況

委託会社

（前略）

・資本金の額

平成23年10月末現在、17,180百万円

・会社の沿革

（中略）

・大株主の状況(平成23年10月末現在)

（以下略）

<訂正後>

(3)ファンドの仕組み

（前略）

委託会社の概況

委託会社

（前略）

・資本金の額

平成24年4月末現在、17,180百万円

・会社の沿革

（中略）

・大株主の状況(平成24年4月末現在)

（以下略）

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

(前略)

ファンドの運用体制等は平成23年12月9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

(前略)

ファンドの運用体制等は平成24年6月15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)

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12月9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)

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24年6月15日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4 手数料等及び税金

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>

(5) 課税上の取扱い

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

平成25年12月31日までの間は、分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離

課税もしくは総合課税(配当控除の適用があります。)のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成26年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

平成25年12月31日までの間は、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10%の税率により源泉徴収が行なわれます。上記10%の税率は平成26年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との通算が可能です。

法人の投資家に対する課税

平成25年12月31日までの間は、分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成26年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

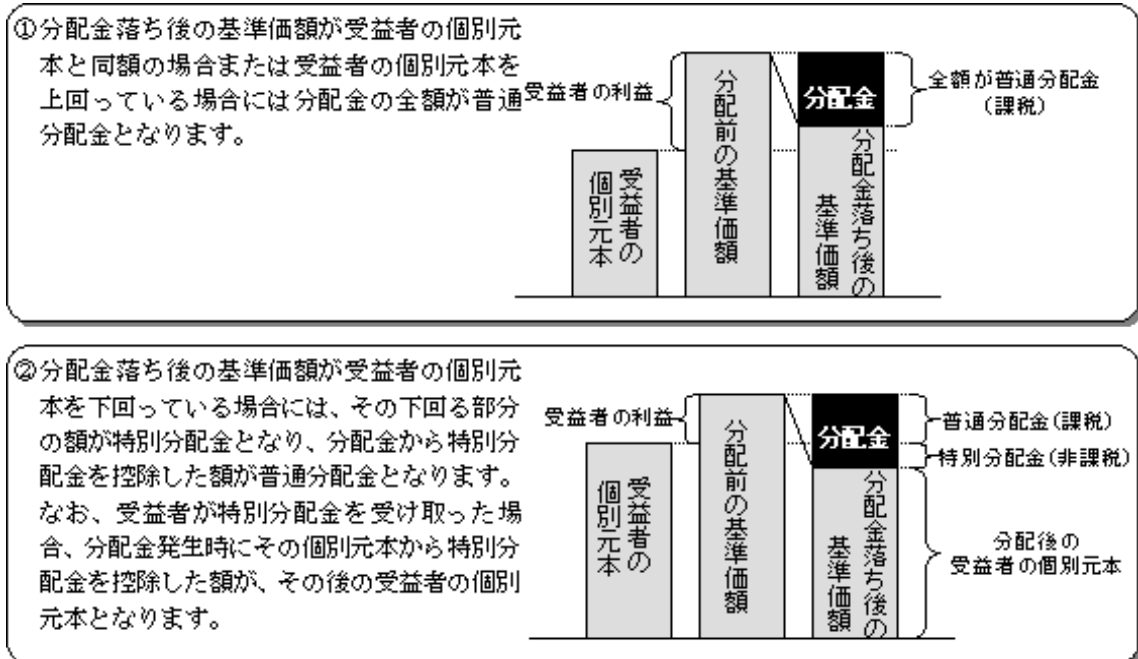
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が特別分配金を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

（ご参考）

お客様に直接ご負担いただく費用・税金

時期	項目	費用	税金
買付時	申込手数料	3.15%（税抜3.0%）以内 ¹	消費税等相当額
換金時 （解約請求制）	信託財産留保額	0.3% ²	

1 基準価額に、3.15%（税抜3.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2 基準価額に0.3%を乗じて得た額とします。

時期	項目	費用	税金
分配時	所得税および地方税		普通分配金×10% ¹
換金時 （解約請求制）	所得税および地方税		換金時の差益（譲渡益） ² に対して10% ¹
償還時	所得税および地方税		償還時の差益（譲渡益） ² に対して10% ¹

1 個人の投資家の場合の税率です。法人の投資家の場合には税率等が異なります。詳しくは前述の「法人の投資家に対する課税」をご覧ください。

2 詳しくは前述の「換金（解約）時および償還時の課税について」をご覧ください。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容が変更になる場合があります。

<訂正後>

(5) 課税上の取扱い

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10%の税率により源泉徴収が行なわれます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10.147%の税率により源泉徴収が行なわれます。なお、上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との通算が可能です。

法人の投資家に対する課税

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7.147%の税率は平成26年1月1日以後、15.315%（所得税15.315%）となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

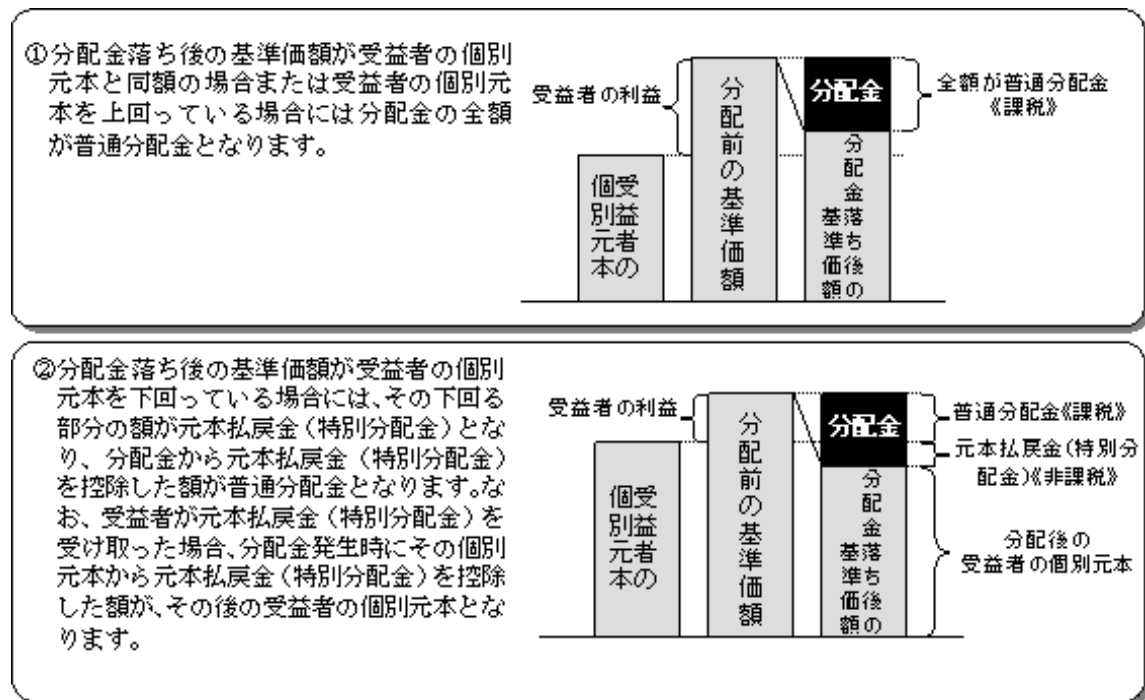
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

(ご参考)

お客様に直接ご負担いただく費用・税金

時期	項目	費用	税金
買付時	申込手数料	3.15%（税抜3.0%）以内 ¹	消費税等相当額
換金時 （解約請求制）	信託財産留保額	0.3% ²	

¹ 基準価額に、3.15%（税抜3.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2 基準価額に0.3%を乗じて得た額とします。

時期	項目	費用	税金
分配時	所得税および地方税		普通分配金×10% ¹
換金時 (解約請求制)	所得税および地方税		換金時の差益（譲渡益） ² に 対して10% ¹
償還時	所得税および地方税		償還時の差益（譲渡益） ² に 対して10% ¹

1 個人の投資家の場合の税率です。法人の投資家の場合には税率等が異なります。詳しくは前述の「法人の投資家に対する課税」をご覧ください。

平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は10.147%、平成26年1月1日以後は20.315%となる予定です。

2 詳しくは前述の「換金（解約）時および償還時の課税について」をご覧ください。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容が変更に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24年4月27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	80,881,116,269	99.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		315,608,229	0.38
合計(純資産総額)		81,196,724,498	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	109,377,304,670	96.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,967,803,031	3.50
合計(純資産総額)		113,345,107,701	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(2012年6月限)	東京証券取引所	株価指数先物	買建	円	221	1,879,605,000	1,773,525,000	1.56

(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	72,806,837,942	1.1569	84,230,230,816	1.1109	80,881,116,269	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	日立製作所	電気機器	5,817,000	497.00	2,891,049,000	512.00	2,978,304,000	2.62

2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,275,900	432.94	3,150,028,146	387.00	2,815,773,300	2.48
3	日本	株式	三菱重工業	機械	7,680,000	400.89	3,078,898,787	364.00	2,795,520,000	2.46
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	747,300	3,820.00	2,854,686,000	3,625.00	2,708,962,500	2.39
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	990,200	2,860.00	2,831,972,000	2,584.00	2,558,676,800	2.25
6	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	1,317,900	1,993.58	2,627,339,407	1,905.00	2,510,599,500	2.21
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	767,000	3,220.00	2,469,740,000	2,896.00	2,221,232,000	1.95
8	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	386,600	5,358.42	2,071,568,487	4,980.00	1,925,268,000	1.69
9	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,030,900	1,983.96	2,045,264,364	1,743.00	1,796,858,700	1.58
10	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	715,400	2,365.00	1,691,921,000	2,423.00	1,733,414,200	1.52
11	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	1,502,200	1,125.25	1,690,354,583	1,089.00	1,635,895,800	1.44
12	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	11,831	140,600.00	1,663,438,600	136,200.00	1,611,382,200	1.42
13	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	477,600	3,445.00	1,645,332,000	3,245.00	1,549,812,000	1.36
14	日本	株式	キヤノン	電気機器	401,500	3,895.00	1,563,842,500	3,670.00	1,473,505,000	1.30
15	日本	株式	三井物産	卸売業	1,156,300	1,404.00	1,623,445,200	1,254.00	1,450,000,200	1.27
16	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,732,900	865.00	1,498,958,500	836.00	1,448,704,400	1.27
17	日本	株式	住友不動産	不動産業	752,000	1,970.84	1,482,073,172	1,924.00	1,446,848,000	1.27
18	日本	株式	ユニ・チャーム	化学	316,700	4,230.00	1,339,641,000	4,460.00	1,412,482,000	1.24
19	日本	株式	味の素	食料品	1,258,000	991.00	1,246,678,000	1,033.00	1,299,514,000	1.14
20	日本	株式	小松製作所	機械	541,900	2,424.00	1,313,565,600	2,315.00	1,254,498,500	1.10
21	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,740,000	718.24	1,249,748,024	707.00	1,230,180,000	1.08
22	日本	株式	ソニー	電気機器	926,500	1,715.89	1,589,779,614	1,316.00	1,219,274,000	1.07
23	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	136,000	8,730.00	1,187,280,000	8,860.00	1,204,960,000	1.06
24	日本	株式	デンソー	輸送用機器	452,200	2,702.91	1,222,258,630	2,609.00	1,179,789,800	1.04
25	日本	株式	住友金属鉱山	非鉄金属	1,094,000	1,175.74	1,286,267,494	1,056.00	1,155,264,000	1.01
26	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	346,800	3,466.07	1,202,033,244	3,305.00	1,146,174,000	1.01
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	555,800	2,231.86	1,240,469,942	2,059.00	1,144,392,200	1.00
28	日本	株式	オリックス	その他金融業	148,070	8,060.00	1,193,444,200	7,680.00	1,137,177,600	1.00
29	日本	株式	いすゞ自動車	輸送用機器	2,268,000	475.00	1,077,300,000	459.00	1,041,012,000	0.91
30	日本	株式	楽天	サービス業	11,486	85,797.25	985,467,274	89,000.00	1,022,254,000	0.90

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	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.21
	建設業	0.87
	食料品	2.20
	繊維製品	0.36
	パルプ・紙	0.48
	化学	8.30
	医薬品	2.56
	石油・石炭製品	0.14
	ゴム製品	2.79
	ガラス・土石製品	0.41
	鉄鋼	1.32
	非鉄金属	2.89
	金属製品	1.97
	機械	7.30
	電気機器	14.06
	輸送用機器	8.98
	精密機器	1.08
	その他製品	1.02
	電気・ガス業	0.87
	陸運業	3.15
	海運業	0.39
	空運業	0.09
	倉庫・運輸関連業	0.76
	情報・通信業	6.94
	卸売業	5.17
	小売業	6.91
	銀行業	6.34
	証券、商品先物取引業	0.08
	保険業	1.78
	その他金融業	1.28
	不動産業	2.34
	サービス業	3.18
	小計	96.49
合計		96.49

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(2012年6月限)	東京証券取引所	株価指数先物	買建	円	221	1,879,605,000	1,773,525,000	1.56

(3) 運用実績
純資産の推移

平成24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
第23期 (2011年9月20日)	81,481	81,481	0.4192	0.4192
第24期 (2012年3月21日)	86,228	86,228	0.4792	0.4792
2011年4月末日	96,928		0.4757	
5月末日	95,246		0.4723	
6月末日	95,013		0.4768	
7月末日	93,413		0.4746	
8月末日	84,502		0.4322	
9月末日	82,425		0.4262	
10月末日	82,284		0.4295	
11月末日	78,038		0.4114	
12月末日	77,161		0.4117	
2012年1月末日	78,533		0.4246	
2月末日	85,102		0.4666	
3月末日	86,262		0.4841	
4月末日	81,196		0.4594	

分配の推移

期	1口当たりの分配金
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
第23期	0.0000 円
第24期	0.0000 円

収益率の推移

期	収益率
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 %
第23期	11.4 %
第24期	14.3 %

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(分配前の額、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。

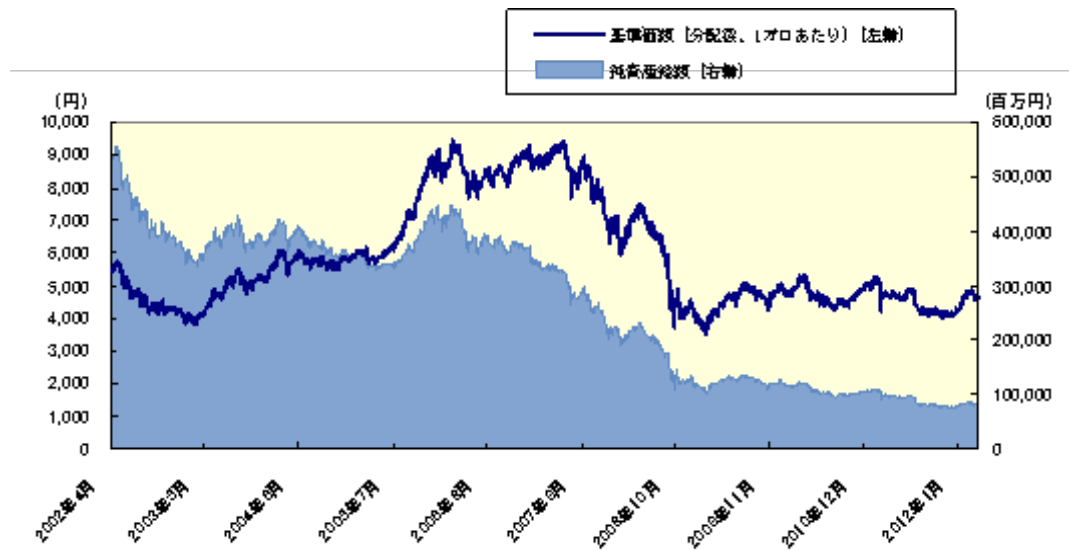
(4) 設定及び解約の実績

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
第23期	1,004,520,813	12,867,822,904	194,392,314,947
第24期	638,439,183	15,101,998,069	179,928,756,061

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（2012年4月27日現在）

[基準価額・純資産の推移]（日次）



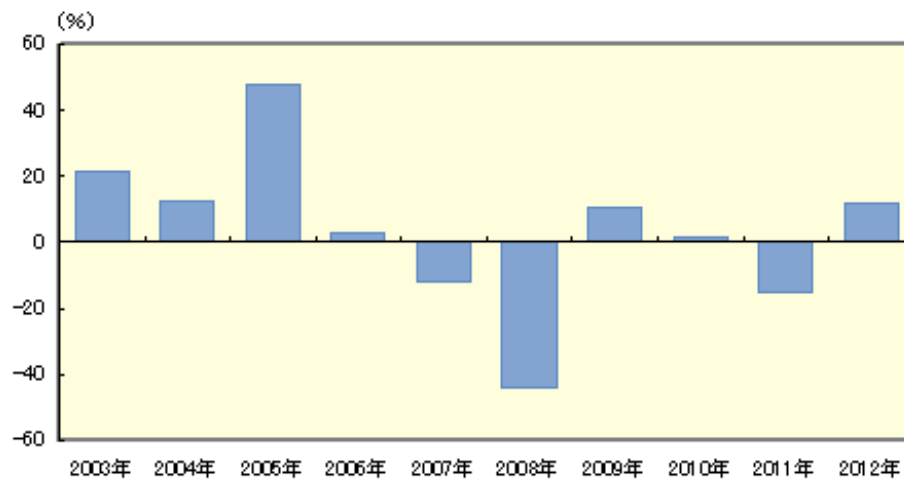
[分配の推移]（1万口あたり、課税前）

2012年3月	0 円
2011年9月	0 円
2011年3月	0 円
2010年9月	0 円
2010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	日立製作所	電気機器	2.6	1	電気機器	14.0
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.5	2	輸送用機器	8.9
3	三菱重工業	機械	2.5	3	化学	8.3
4	日本電信電話	情報・通信業	2.4	4	機械	7.3
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.2	5	情報・通信業	6.9
6	ブリヂストン	ゴム製品	2.2			
7	本田技研工業	輸送用機器	1.9			
8	東日本旅客鉄道	陸運業	1.7			
9	三菱商事	卸売業	1.6			
10	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1.5			

[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。
- ・2012年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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24期計算期間(平成23年9月21日から平成24年3月21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

ノムラ日本株戦略ファンド

(1)貸借対照表

期別	第23期 平成23年9月20日現在	第24期 平成24年3月21日現在
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,325,209,695	1,246,825,788
親投資信託受益証券	81,127,302,931	85,865,665,538
未収利息	3,315	2,936
流動資産合計	82,452,515,941	87,112,494,262
資産合計	82,452,515,941	87,112,494,262
負債の部		
流動負債		
未払解約金	51,246,997	83,389,301
未払受託者報酬	35,951,385	32,847,292
未払委託者報酬	882,555,916	766,474,752
その他未払費用	1,450,214	1,262,029
流動負債合計	971,204,512	883,973,374
負債合計	971,204,512	883,973,374
純資産の部		
元本等		
元本	194,392,314,947	179,928,756,061
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	112,911,003,518	93,700,235,173
(分配準備積立金)	5,874,476,771	6,216,736,404
元本等合計	81,481,311,429	86,228,520,888
純資産合計	81,481,311,429	86,228,520,888
負債純資産合計	82,452,515,941	87,112,494,262

(2)損益及び剰余金計算書

科目	期別	第23期	第24期
		自 平成23年3月23日 至 平成23年9月20日 金額(円)	自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21日 金額(円)
営業収益			
受取利息		415,575	377,337
有価証券売買等損益		9,710,391,769	11,760,910,594
営業収益合計		9,709,976,194	11,761,287,931
営業費用			
受託者報酬		35,951,385	32,847,292
委託者報酬		882,555,916	766,474,752
その他費用		1,450,214	1,262,029
営業費用合計		919,957,515	800,584,073
営業利益		10,629,933,709	10,960,703,858
経常利益		10,629,933,709	10,960,703,858
当期純利益		10,629,933,709	10,960,703,858
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		143,684,406	167,038,589
期首剰余金又は期首欠損金()		108,656,146,459	112,911,003,518
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,794,246,374	8,785,302,477
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,794,246,374	8,785,302,477
剰余金減少額又は欠損金増加額		562,854,130	368,199,401
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		562,854,130	368,199,401
分配金			
期末剰余金又は期末欠損金()		112,911,003,518	93,700,235,173

(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) 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1) 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3 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。
4 その他	当ファンドの計算期間は期末が休日のため、平成23年9月21日から平成24年3月21日までとなっております。

(追加情報)

第24期
自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

第23期 平成23年9月20日現在	第24期 平成24年3月21日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 194,392,314,947 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 179,928,756,061 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 112,911,003,518 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 93,700,235,173 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 0.4192 円 (10,000口当たり純資産額 4,192 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 0.4792 円 (10,000口当たり純資産額 4,792 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第23期 自 平成23年3月23日 至 平成23年9月20日	第24期 自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21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23期 自 平成23年3月23日 至 平成23年9月20日	第24期 自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21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。	1 金融商品に対する取組方針 同左
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。	2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左
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。	3 金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第23期 平成23年9月20日現在	第24期 平成24年3月21日現在
<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第23期 自 平成23年3月23日 至 平成23年9月20日	第24期 自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21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23期 自 平成23年3月23日 至 平成23年9月20日	第24期 自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21日
期首元本額 206,255,617,038 円	期首元本額 194,392,314,947 円
期中追加設定元本額 1,004,520,813 円	期中追加設定元本額 638,439,183 円
期中一部解約元本額 12,867,822,904 円	期中一部解約元本額 15,101,998,069 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第23期 自 平成23年3月23日 至 平成23年9月20日	第24期 自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21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	9,582,985,459	11,541,283,594
合計	9,582,985,459	11,541,283,594

3 デリバティブ取引関係

第23期(平成23年9月20日現在)

該当事項はございません。

第24期(平成24年3月21日現在)

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24年3月21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24年3月21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		85,865,665,538	
親投資信託受益証券計	銘柄数：1		85,865,665,538	
	組入時価比率：99.6%		100.0%	
合計			85,865,665,538	

(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

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

対象年月日	平成24年3月21日現在
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,130,838,529
株式	116,924,764,490
派生商品評価勘定	58,536,770
未収入金	168,049,907
未収配当金	185,336,850
未収利息	7,374
流動資産合計	120,467,533,920
資産合計	120,467,533,920
負債の部	
流動負債	
前受金	39,891,000
未払金	86,859,289
流動負債合計	126,750,289
負債合計	126,750,289
純資産の部	
元本等	
元本	104,021,401,809
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	16,319,381,822
元本等合計	120,340,783,631
純資産合計	120,340,783,631
負債純資産合計	120,467,533,920

(2)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	<p>(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、市場価格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。</p> <p>(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。</p>
2 費用・収益の計上基準	<p>(1) 受取配当金 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。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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。</p>

(追加情報)

自 平成23年9月21日 至 平成24年3月21日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成24年3月21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 (10,000口当たり純資産額)	1,1569 円 11,569 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23年9月21日 至 平成24年3月21日	
1	<p>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>
2	<p>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。</p>
3	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月21日現在	
1	<p>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。</p>
2	<p>時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

(その他の注記)

平成24年3月21日現在	
1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年9月21日
期首元本額	111,262,475,321 円
期首より平成24年3月21日までの期中追加設定元本額	778,107,986 円
期首より平成24年3月21日までの期中一部解約元本額	8,019,181,498 円
期末元本額	104,021,401,809 円
期末元本額の内訳*	
ノムラ日本株戦略ファンド	74,220,473,281 円
ノムラ日本株戦略ファンド(野村SMA向け)	390,283,224 円
ノムラ日本株戦略ファンドVA(適格機関投資家専用)	25,869,753,678 円
ノムラ日本株戦略ファンド(確定拠出年金向け)	3,540,891,626 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24年3月21日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日本水産	377,300	287.00	108,285,100	
	国際石油開発帝石	268	563,000.00	150,884,000	
	石油資源開発	28,800	3,920.00	112,896,000	
	ミライト・ホールディングス	180,600	589.00	106,373,400	
	大林組	336,000	370.00	124,320,000	
	関電工	255,000	414.00	105,570,000	
	きんでん	143,000	659.00	94,237,000	
	日揮	208,000	2,609.00	542,672,000	
	高砂熱学工業	116,200	654.00	75,994,800	
	S Foods	21,000	661.00	13,881,000	
	サッポロホールディングス	369,000	301.00	111,069,000	
	麒麟ホールディングス	462,000	1,025.00	473,550,000	
	日清オイリオグループ	405,000	354.00	143,370,000	
	不二製油	421,900	1,171.00	494,044,900	
	味の素	1,378,000	991.00	1,365,598,000	
	わらべや日洋	48,400	1,247.00	60,354,800	
	日清紡ホールディングス	160,000	787.00	125,920,000	
	東レ	489,000	615.00	300,735,000	
	王子製紙	1,415,000	406.00	574,490,000	
	クラレ	500,200	1,217.00	608,743,400	
	旭化成	198,000	506.00	100,188,000	
	昭和電工	4,035,000	187.00	754,545,000	
	住友化学	1,890,000	364.00	687,960,000	
	クレハ	288,000	400.00	115,200,000	
	信越化学工業	89,600	4,700.00	421,120,000	
	堺化学工業	362,000	318.00	115,116,000	
	大陽日酸	856,000	563.00	481,928,000	
	四国化成工業	255,000	496.00	126,480,000	
	日本触媒	625,000	960.00	600,000,000	
	三菱瓦斯化学	1,722,000	549.00	945,378,000	
	J S R	186,900	1,717.00	320,907,300	
	三菱ケミカルホールディングス	1,306,000	449.00	586,394,000	
	ダイセル	1,445,000	530.00	765,850,000	
	宇部興産	2,599,000	235.00	610,765,000	

	日立化成工業	199,500	1,555.00	310,222,500	
	ADEKA	285,900	785.00	224,431,500	
	三洋化成工業	196,000	554.00	108,584,000	
	東洋インキSCホールディングス	534,000	340.00	181,560,000	
	富士フイルムホールディングス	154,300	2,035.00	314,000,500	
	ドクターシーラボ	225	374,000.00	84,150,000	
	上村工業	41,400	3,190.00	132,066,000	
	荒川化学工業	156,700	711.00	111,413,700	
	レック	67,300	1,289.00	86,749,700	
	エフピコ	25,300	5,080.00	128,524,000	
	ニフコ	37,800	2,228.00	84,218,400	
	ユニ・チャーム	328,300	4,230.00	1,388,709,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	協和発酵キリン	445,000	886.00	394,270,000	
	アステラス製薬	477,600	3,445.00	1,645,332,000	
	中外製薬	568,400	1,436.00	816,222,400	
	科研製薬	50,000	1,055.00	52,750,000	
	日医工	64,100	1,850.00	118,585,000	
	鳥居薬品	35,300	1,530.00	54,009,000	
	JXホールディングス	1,043,600	523.00	545,802,800	
	ブリヂストン	1,241,700	2,001.00	2,484,641,700	
	住友ゴム工業	590,300	1,092.00	644,607,600	
	旭硝子	170,000	718.00	122,060,000	
	東海カーボン	249,000	444.00	110,556,000	
	TOTO	441,000	630.00	277,830,000	
	日本碍子	100,000	1,143.00	114,300,000	
	新日本製鐵	578,000	235.00	135,830,000	
	住友金属工業	2,017,000	170.00	342,890,000	
	神戸製鋼所	2,272,000	141.00	320,352,000	
	日新製鋼	798,000	142.00	113,316,000	
	ジェイ エフ イー ホールディ ングス	79,900	1,832.00	146,376,800	
	大和工業	94,200	2,357.00	222,029,400	
	大阪製鐵	172,800	1,613.00	278,726,400	
	住友鋼管	118,800	774.00	91,951,200	
	中部鋼鈹	280,800	461.00	129,448,800	
	大同特殊鋼	218,000	585.00	127,530,000	
	日立金属	111,000	1,013.00	112,443,000	
	東邦亜鉛	380,000	379.00	144,020,000	
	住友金属鉱山	1,120,000	1,178.00	1,319,360,000	
	DOWAホールディングス	499,000	577.00	287,923,000	
	住友電気工業	1,390,800	1,131.00	1,572,994,800	
	アサヒホールディングス	68,100	1,752.00	119,311,200	
	三和ホールディングス	952,000	317.00	301,784,000	
	文化シャッター	416,000	287.00	119,392,000	
	住生活グループ	502,000	1,780.00	893,560,000	
	リンナイ	93,300	5,840.00	544,872,000	
	パイオラックス	148,600	2,211.00	328,554,600	
	日本発條	99,300	881.00	87,483,300	
	三益半導体工業	105,600	804.00	84,902,400	
	富士機械製造	69,100	1,650.00	114,015,000	
	牧野フライス製作所	165,000	684.00	112,860,000	
	ナブテスコ	107,600	1,772.00	190,667,200	
	三井海洋開発	158,000	1,701.00	268,758,000	
	S M C	36,000	13,320.00	479,520,000	
	オイレス工業	136,100	1,665.00	226,606,500	
	小松製作所	613,000	2,424.00	1,485,912,000	
	クボタ	578,000	813.00	469,914,000	
	小森コーポレーション	185,600	677.00	125,651,200	
	荏原製作所	387,000	316.00	122,292,000	
	ダイキン工業	194,600	2,225.00	432,985,000	
	椿本チエイン	318,000	506.00	160,908,000	

ダイフク	176,500	486.00	85,779,000
サンデン	346,000	289.00	99,994,000
マックス	81,000	1,043.00	84,483,000
グローリー	72,000	1,750.00	126,000,000
日本精工	273,000	650.00	177,450,000
マキタ	228,600	3,485.00	796,671,000
日立造船	2,760,500	114.00	314,697,000
三菱重工業	7,565,000	401.00	3,033,565,000
ミネベア	422,000	388.00	163,736,000
日立製作所	6,718,000	497.00	3,338,846,000
東芝	1,706,000	375.00	639,750,000
三菱電機	1,785,000	719.00	1,283,415,000
安川電機	579,000	793.00	459,147,000
東芝テック	322,000	332.00	106,904,000
マブチモーター	38,900	3,840.00	149,376,000
日本電産	61,900	7,250.00	448,775,000
メルコホールディングス	53,900	2,038.00	109,848,200
日本電気	3,668,000	170.00	623,560,000
富士通	269,000	433.00	116,477,000
パナソニック	1,039,800	763.00	793,367,400
日立国際電気	300,000	711.00	213,300,000
ソニー	998,000	1,733.00	1,729,534,000
T D K	178,100	4,595.00	818,369,500

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	アルプス電気	207,900	738.00	153,430,200	
	日本電波工業	69,800	1,261.00	88,017,800	
	日本光電工業	51,700	2,166.00	111,982,200	
	パナソニック電工SUNX	207,600	420.00	87,192,000	
	キーエンス	42,350	19,030.00	805,920,500	
	シスメックス	42,500	3,160.00	134,300,000	
	イリソ電子工業	81,700	1,550.00	126,635,000	
	ファナック	71,700	15,360.00	1,101,312,000	
	大真空	171,000	306.00	52,326,000	
	ローム	29,700	4,115.00	122,215,500	
	浜松ホトニクス	175,100	3,030.00	530,553,000	
	京セラ	65,900	7,560.00	498,204,000	
	太陽誘電	152,800	896.00	136,908,800	
	村田製作所	68,000	4,940.00	335,920,000	
	ニチコン	104,600	1,049.00	109,725,400	
	小糸製作所	279,000	1,325.00	369,675,000	
	キヤノン電子	61,800	2,039.00	126,010,200	
	キヤノン	421,000	3,895.00	1,639,795,000	
	リコー	136,000	821.00	111,656,000	
	東京エレクトロン	102,100	4,755.00	485,485,500	
	デンソー	329,900	2,770.00	913,823,000	
	日産自動車	1,755,400	865.00	1,518,421,000	
	いすゞ自動車	2,450,000	475.00	1,163,750,000	
	トヨタ自動車	263,000	3,520.00	925,760,000	
	日野自動車	781,000	576.00	449,856,000	
	武蔵精密工業	72,200	1,900.00	137,180,000	
	新明和工業	303,000	392.00	118,776,000	
	タチエス	88,000	1,618.00	142,384,000	
	プレス工業	251,000	546.00	137,046,000	
	アイシン精機	192,500	2,922.00	562,485,000	
	ダイハツ工業	583,000	1,488.00	867,504,000	
	本田技研工業	777,700	3,220.00	2,504,194,000	
	スズキ	172,000	1,970.00	338,840,000	
	愛三工業	107,500	782.00	84,065,000	
	シマノ	71,900	4,760.00	342,244,000	
	テルモ	186,800	3,985.00	744,398,000	
	日機装	141,000	821.00	115,761,000	
	タムロン	55,900	2,570.00	143,663,000	
	朝日インテック	179,900	1,976.00	355,482,400	
	バンダイナムコホールディングス	123,400	1,169.00	144,254,600	
	大建工業	197,000	280.00	55,160,000	
	ヤマハ	198,200	822.00	162,920,400	
	リンテック	63,800	1,703.00	108,651,400	
	任天堂	65,100	12,590.00	819,609,000	
	東京瓦斯	2,569,000	394.00	1,012,186,000	
	東日本旅客鉄道	317,600	5,380.00	1,708,688,000	
	ハマキョウレックス	123,600	2,535.00	313,326,000	
	日本通運	456,000	327.00	149,112,000	

ヤマトホールディングス	662,200	1,283.00	849,602,600
福山通運	210,000	457.00	95,970,000
セイノーホールディングス	201,000	588.00	118,188,000
日立物流	100,800	1,468.00	147,974,400
日本郵船	1,860,000	261.00	485,460,000
スカイマーク	177,500	611.00	108,452,500
日新	197,000	220.00	43,340,000
三菱倉庫	304,000	967.00	293,968,000
三井倉庫	359,000	328.00	117,752,000
住友倉庫	285,000	412.00	117,420,000
郵船ロジスティクス	162,500	1,226.00	199,225,000
近鉄エクスプレス	67,300	2,747.00	184,873,100
ITホールディングス	312,100	963.00	300,552,300
フジ・メディア・ホールディングス	2,349	131,800.00	309,598,200
ヤフー	9,816	27,240.00	267,387,840
シーエーシー	121,000	693.00	83,853,000
オービックビジネスコンサルタント	24,600	3,850.00	94,710,000
日本テレビ放送網	8,190	12,640.00	103,521,600
スカパーJSATホールディングス	5,936	36,600.00	217,257,600
日本電信電話	747,300	3,820.00	2,854,686,000
KDDI	1,128	530,000.00	597,840,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	12,227	140,600.00	1,719,116,200
角川グループホールディングス	101,800	2,586.00	263,254,800

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	エヌ・ティ・ティ・データ	381	292,900.00	111,594,900	
	D T S	76,500	1,065.00	81,472,500	
	スクウェア・エニックス・ホールディングス	274,600	1,626.00	446,499,600	
	ソフトバンク	174,700	2,392.00	417,882,400	
	トシン・グループ	60,400	2,000.00	120,800,000	
	シップヘルスケアホールディングス	92,100	1,631.00	150,215,100	
	伯東	103,800	821.00	85,219,800	
	シークス	318,700	1,181.00	376,384,700	
	マクニカ	60,700	1,865.00	113,205,500	
	伊藤忠商事	323,800	938.00	303,724,400	
	丸紅	565,000	620.00	350,300,000	
	三井物産	1,444,800	1,404.00	2,028,499,200	
	日立ハイテクノロジーズ	234,500	1,930.00	452,585,000	
	住友商事	385,500	1,247.00	480,718,500	
	三菱商事	1,057,400	1,986.00	2,099,996,400	
	阪和興業	378,000	381.00	144,018,000	
	伊藤忠エネクス	168,400	499.00	84,031,600	
	トラスコ中山	67,900	1,694.00	115,022,600	
	ローソン	106,300	4,940.00	525,122,000	
	アスクル	131,900	1,381.00	182,153,900	
	ゲオホールディングス	884	97,800.00	86,455,200	
	ポイント	20,640	2,895.00	59,752,800	
	ナフコ	76,600	1,447.00	110,840,200	
	ジェイアイエヌ	132,000	1,139.00	150,348,000	
	D C Mホールディングス	131,100	620.00	81,282,000	
	MonotaRO	139,100	1,172.00	163,025,200	
	スタートトゥデイ	87,000	1,342.00	116,754,000	
	三越伊勢丹ホールディングス	784,400	955.00	749,102,000	
	グローウェルホールディングス	143,300	2,312.00	331,309,600	
	クリエイトSDホールディングス	30,300	1,978.00	59,933,400	
	ブックオフコーポレーション	150,500	788.00	118,594,000	
	あさひ	29,600	1,426.00	42,209,600	
	セブン&アイ・ホールディングス	774,700	2,365.00	1,832,165,500	
	良品計画	148,700	4,150.00	617,105,000	
	ピーシーデポコーポレーション	5,167	21,000.00	108,507,000	
	スギホールディングス	64,900	2,400.00	155,760,000	
	島忠	55,700	1,875.00	104,437,500	
	マックスバリュ東海	107,200	1,105.00	118,456,000	
	オークワ	96,000	1,152.00	110,592,000	
	コメリ	19,700	2,295.00	45,211,500	
	青山商事	72,900	1,587.00	115,692,300	
	松屋	187,800	648.00	121,694,400	
	エイチ・ツー・オー リテイリング	184,000	693.00	127,512,000	

パルコ	67,300	794.00	53,436,200
平和堂	24,700	1,078.00	26,626,600
ゼビオ	306,500	2,061.00	631,696,500
アークランドサカモト	71,600	1,427.00	102,173,200
ニトリホールディングス	107,200	7,000.00	750,400,000
アークス	102,900	1,446.00	148,793,400
ファーストリテイリング	4,500	18,000.00	81,000,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,173,500	434.00	3,113,299,000
りそなホールディングス	1,584,000	410.00	649,440,000
三井住友トラスト・ホールディングス	428,000	277.00	118,556,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,020,500	2,860.00	2,918,630,000
千葉銀行	271,000	520.00	140,920,000
横浜銀行	744,000	403.00	299,832,000
武蔵野銀行	40,100	2,865.00	114,886,500
スルガ銀行	192,000	808.00	155,136,000
京都銀行	135,000	733.00	98,955,000
みずほフィナンシャルグループ	2,177,700	143.00	311,411,100
京葉銀行	348,000	399.00	138,852,000
マネックスグループ	7,635	19,010.00	145,141,350
ライフネット生命保険	101,600	1,050.00	106,680,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	249,000	1,742.00	433,758,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	76,700	1,507.00	115,586,900
東京海上ホールディングス	477,900	2,262.00	1,081,009,800
T&Dホールディングス	313,900	1,029.00	323,003,100
芙蓉総合リース	28,800	2,929.00	84,355,200
イオンクレジットサービス	70,300	1,299.00	91,319,700
日立キャピタル	94,600	1,243.00	117,587,800

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	オリックス	148,070	8,060.00	1,193,444,200	
	大阪証券取引所	117	462,000.00	54,054,000	
	一建設	49,200	2,111.00	103,861,200	
	パーク24	77,300	1,043.00	80,623,900	
	東京建物	721,000	337.00	242,977,000	
	ダイビル	228,100	618.00	140,965,800	
	東急不動産	1,123,000	414.00	464,922,000	
	住友不動産	718,000	1,977.00	1,419,486,000	
	明和地所	120,500	485.00	58,442,500	
	ミクシィ	212	211,500.00	44,838,000	
	総合警備保障	279,000	972.00	271,188,000	
	カカクコム	42,500	2,113.00	89,802,500	
	エムスリー	131	288,600.00	37,806,600	
	ファンコミュニケーションズ	1,782	94,200.00	167,864,400	
	オリエンタルランド	140,400	8,730.00	1,225,692,000	
	もしもしホットライン	70,500	830.00	58,515,000	
	楽天	9,704	85,300.00	827,751,200	
	西尾レントオール	121,300	1,073.00	130,154,900	
	セコム	79,200	4,025.00	318,780,000	
	ダイセキ	75,700	1,526.00	115,518,200	
計	銘柄数：278			116,924,764,490	
	組入時価比率：97.2%			100.0%	
合計				116,924,764,490	

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24年3月21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24年3月21日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	
	うち1年超			
市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建	1,820,929,000		1,879,605,000	58,536,770
合計	1,820,929,000		1,879,605,000	58,536,770

(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24年4月27日現在

資産総額	81,446,975,252	円
負債総額	250,250,754	円
純資産総額(-)	81,196,724,498	円
発行済口数	176,763,784,951	口
1口当たり純資産額(/)	0.4594	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	115,469,662,574	円
負債総額	2,124,554,873	円
純資産総額(-)	113,345,107,701	円
発行済口数	102,033,031,106	口
1口当たり純資産額(/)	1.1109	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23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24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24年3月30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	765	10,246,303
単位型株式投資信託	38	239,129

追加型公社債投資信託	18	4,783,408
単位型公社債投資信託	0	0
合計	821	15,268,839

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) 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9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・クレア証券株式会社	3,794百万円	
岩井証券株式会社 ^{1, 3}	3,000百万円	
ひろぎんウツミ屋証券株式会社	6,100百万円	
ひびき証券株式会社 ¹	500百万円	
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	
あかつき証券株式会社	2,065百万円	
コスモ証券株式会社 ³	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IT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	
浜銀IT証券株式会社	3,307百万円	
前田証券株式会社 ⁴	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	18,000百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
明和証券株式会社	511百万円	
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9月末現在

- 1 岩井証券株式会社、ひびき証券株式会社、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・販売は行ないません。
- 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。
- 3 岩井証券株式会社とコスモ証券株式会社は、平成24年5月1日付をもって合併し、岩井コスモ証券株式会社（資本金：13,500百万円）となる予定です。

4 前田証券株式会社は、平成24年4月1日付をもって、ふくおか証券株式会社に社名変更する予定です。

<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24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	
ひろぎんウツミ屋証券株式会社	6,100百万円	
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	
あかつき証券株式会社	2,065百万円	
岩井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	
浜銀TT証券株式会社	3,307百万円	
ふくおか証券株式会社	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	40,500百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
明和證券株式会社	511百万円	
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	2,014百万円 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24年3月末現在

- 1 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・販売は行ないません。
- 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。

独立監査人の監査報告書

平成24年5月14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 公認会計士 内田 満 雄
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志 保
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」に掲げられているノムラ日本株戦略ファンドの平成23年9月21日から平成24年3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。

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、ノムラ日本株戦略ファンドの平成24年3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。

利害関係

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。