

【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3月29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】 東証銀行業株価指数連動型上場投資信託
なお、「銀行業上場投信」または、「銀行業投信」と称する場合があります。

【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9月30日から平成24年9月27日まで)
20兆円を上限とする。
* 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せん。

【縦覧に供する場所】 株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成23年9月29日付をもって提出した有価証券届出書（平成23年10月27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

(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8月末現在、17,180百万円

(中略)

・大株主の状況(平成23年8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24年2月末現在、17,180百万円

(中略)

・大株主の状況(平成24年2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23年9月29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24年3月29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9月29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3月29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>

(3) 信託報酬等

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の23.1(税抜年10,000分の22)以内(平成23年9月29日現在年10,000分の23.1(税抜年10,000分の22))の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

(委託会社) (受託会社)

年10,000分の15 年10,000分の7

上記配分は、平成23年9月29日現在の信託報酬率における配分です。

上記の信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払われます。

<訂正後>

(3) 信託報酬等

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の23.1(税抜年10,000分の22)以内(平成24年3月29日現在年10,000分の23.1(税抜年10,000分の22))の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

| | |
|-------------|------------|
| (委託会社) | (受託会社) |
| 年10,000分の15 | 年10,000分の7 |

上記配分は、平成24年3月29日現在の信託報酬率における配分です。

上記の信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払われます。

<訂正前>

(5) 課税上の取扱い

個人の受益者に対する課税

受益権の売却時

平成25年12月31日までの間は、売却時の差益(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。

収益分配金の受取り時

平成25年12月31日までの間は、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。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記「受益権の売却時」と同様の取扱いとなります。

譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について

売却時及び交換時の差損(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。

(以下 略)

<訂正後>

(5) 課税上の取扱い

個人の受益者に対する課税

受益権の売却時

[平成24年12月31日までの間]

売却時の差益(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]

売却時の差益(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。

収益分配金の受取り時

[平成24年12月31日までの間]

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。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記「受益権の売却時」と同様の取扱いとなります。

譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について

売却時及び交換時の差損（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。

（以下 略）

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1月31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(%) |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 23,585,851,400 | 98.40 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 381,202,826 | 1.59 |
| 合計(純資産総額) | | 23,967,054,226 | 100.00 |

(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 | 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 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 17,906,100 | 390.32 | 6,989,108,952 | 349.00 | 6,249,228,900 | 26.07 |
| 2 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,788,800 | 2,422.19 | 4,332,813,472 | 2,425.00 | 4,337,840,000 | 18.09 |
| 3 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 30,390,700 | 127.00 | 3,859,618,900 | 115.00 | 3,494,930,500 | 14.58 |
| 4 | 日本 | 株式 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 銀行業 | 4,636,000 | 284.29 | 1,317,968,440 | 238.00 | 1,103,368,000 | 4.60 |
| 5 | 日本 | 株式 | りそなホールディングス | 銀行業 | 2,058,600 | 375.59 | 773,189,574 | 339.00 | 697,865,400 | 2.91 |
| 6 | 日本 | 株式 | 静岡銀行 | 銀行業 | 714,000 | 745.45 | 532,251,300 | 782.00 | 558,348,000 | 2.32 |
| 7 | 日本 | 株式 | 横浜銀行 | 銀行業 | 1,519,000 | 392.27 | 595,858,130 | 353.00 | 536,207,000 | 2.23 |
| 8 | 日本 | 株式 | 千葉銀行 | 銀行業 | 933,000 | 494.14 | 461,032,620 | 472.00 | 440,376,000 | 1.83 |
| 9 | 日本 | 株式 | ふくおかフィナンシャルグループ | 銀行業 | 960,000 | 341.66 | 327,993,600 | 325.00 | 312,000,000 | 1.30 |
| 10 | 日本 | 株式 | 常陽銀行 | 銀行業 | 911,000 | 343.88 | 313,274,680 | 337.00 | 307,007,000 | 1.28 |
| 11 | 日本 | 株式 | 京都銀行 | 銀行業 | 423,000 | 740.01 | 313,024,230 | 657.00 | 277,911,000 | 1.15 |
| 12 | 日本 | 株式 | ほくほくフィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,657,000 | 164.10 | 271,913,700 | 152.00 | 251,864,000 | 1.05 |
| 13 | 日本 | 株式 | 広島銀行 | 銀行業 | 698,000 | 355.44 | 248,097,120 | 358.00 | 249,884,000 | 1.04 |
| 14 | 日本 | 株式 | 群馬銀行 | 銀行業 | 540,000 | 423.82 | 228,862,800 | 415.00 | 224,100,000 | 0.93 |
| 15 | 日本 | 株式 | 中国銀行 | 銀行業 | 194,000 | 1,011.84 | 196,296,960 | 1,040.00 | 201,760,000 | 0.84 |
| 16 | 日本 | 株式 | 八十二銀行 | 銀行業 | 436,000 | 455.14 | 198,441,040 | 447.00 | 194,892,000 | 0.81 |
| 17 | 日本 | 株式 | 伊予銀行 | 銀行業 | 253,000 | 755.86 | 191,232,580 | 732.00 | 185,196,000 | 0.77 |
| 18 | 日本 | 株式 | 西日本シティ銀行 | 銀行業 | 830,000 | 243.24 | 201,889,200 | 223.00 | 185,090,000 | 0.77 |
| 19 | 日本 | 株式 | 山口フィナンシャルグループ | 銀行業 | 236,000 | 789.46 | 186,312,560 | 730.00 | 172,280,000 | 0.71 |
| 20 | 日本 | 株式 | 新生銀行 | 銀行業 | 1,842,000 | 86.43 | 159,204,060 | 86.00 | 158,412,000 | 0.66 |
| 21 | 日本 | 株式 | スルガ銀行 | 銀行業 | 231,000 | 702.75 | 162,335,250 | 678.00 | 156,618,000 | 0.65 |
| 22 | 日本 | 株式 | あおぞら銀行 | 銀行業 | 737,000 | 175.82 | 129,579,340 | 212.00 | 156,244,000 | 0.65 |
| 23 | 日本 | 株式 | 七十七銀行 | 銀行業 | 371,000 | 361.59 | 134,149,890 | 350.00 | 129,850,000 | 0.54 |
| 24 | 日本 | 株式 | 滋賀銀行 | 銀行業 | 222,000 | 459.78 | 102,071,160 | 515.00 | 114,330,000 | 0.47 |
| 25 | 日本 | 株式 | 池田泉州ホールディングス | 銀行業 | 976,000 | 119.17 | 116,309,920 | 115.00 | 112,240,000 | 0.46 |
| 26 | 日本 | 株式 | 紀陽ホールディングス | 銀行業 | 942,000 | 108.88 | 102,564,960 | 119.00 | 112,098,000 | 0.46 |
| 27 | 日本 | 株式 | 阿波銀行 | 銀行業 | 208,000 | 515.98 | 107,323,840 | 516.00 | 107,328,000 | 0.44 |
| 28 | 日本 | 株式 | セブン銀行 | 銀行業 | 664,700 | 161.85 | 107,584,475 | 160.00 | 106,352,000 | 0.44 |
| 29 | 日本 | 株式 | 札幌北洋ホールディングス | 銀行業 | 356,700 | 346.72 | 123,675,024 | 274.00 | 97,735,800 | 0.40 |
| 30 | 日本 | 株式 | 武蔵野銀行 | 銀行業 | 38,100 | 2,773.77 | 105,680,637 | 2,563.00 | 97,650,300 | 0.40 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|-----|---------|
| 株式 | 銀行業 | 98.40 |
| 合計 | | 98.40 |

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

平成24年1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及び金融商品取引所の取引価格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) | | 東京証券取引所 取引価格 |
|------------------|------------|---------|--------------|--------|-----------------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) | (終値・1口 当たり円) |
| 第1期 (2003年7月15日) | 4,884 | 4,909 | 162.56 | 163.41 | 164 |
| 第2期 (2004年7月15日) | 6,944 | 6,968 | 276.60 | 277.52 | 278 |
| 第3期 (2005年7月15日) | 10,072 | 10,117 | 286.77 | 288.05 | 288 |
| 第4期 (2006年7月15日) | 107,672 | 107,958 | 448.25 | 449.44 | 451 |
| 第5期 (2007年7月15日) | 231,711 | 232,793 | 402.75 | 404.63 | 402 |
| 第6期 (2008年7月15日) | 90,294 | 91,701 | 268.20 | 272.38 | 269 |
| 第7期 (2009年7月15日) | 31,024 | 31,736 | 156.84 | 160.44 | 157 |
| 第8期 (2010年7月15日) | 32,432 | 33,235 | 123.21 | 126.26 | 123 |
| 第9期 (2011年7月15日) | 24,789 | 25,534 | 115.48 | 118.95 | 116 |
| 2011年1月末日 | 29,487 | | 129.09 | | 130 |
| 2月末日 | 31,578 | | 138.25 | | 139 |
| 3月末日 | 27,122 | | 121.37 | | 121 |
| 4月末日 | 25,798 | | 118.00 | | 117 |
| 5月末日 | 25,150 | | 114.57 | | 115 |
| 6月末日 | 26,028 | | 118.57 | | 119 |
| 7月末日 | 24,442 | | 113.86 | | 115 |
| 8月末日 | 23,788 | | 105.88 | | 106 |
| 9月末日 | 25,367 | | 110.45 | | 109 |
| 10月末日 | 24,477 | | 106.58 | | 107 |
| 11月末日 | 23,507 | | 102.35 | | 103 |
| 12月末日 | 23,674 | | 103.08 | | 103 |
| 2012年1月末日 | 23,967 | | 109.01 | | 109 |

第4期末(2006年7月15日)及び第5期末(2007年7月15日)は休日のため、前営業日の取引価格を記載しております。

分配の推移

| 期 | 1口当たりの分配金 |
|-----|-----------|
| 第1期 | 0.8500 円 |
| 第2期 | 0.9200 円 |
| 第3期 | 1.2800 円 |
| 第4期 | 1.1900 円 |
| 第5期 | 1.8800 円 |
| 第6期 | 4.1800 円 |
| 第7期 | 3.6000 円 |
| 第8期 | 3.0500 円 |
| 第9期 | 3.4700 円 |

収益率の推移

| 期 | 収益率 |
|-----------|--------|
| 第1期 | 18.3 % |
| 第2期 | 70.7 % |
| 第3期 | 4.1 % |
| 第4期 | 56.7 % |
| 第5期 | 9.7 % |
| 第6期 | 32.4 % |
| 第7期 | 40.2 % |
| 第8期 | 19.5 % |
| 第9期 | 3.5 % |
| 第10期(中間期) | 9.1 % |

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。

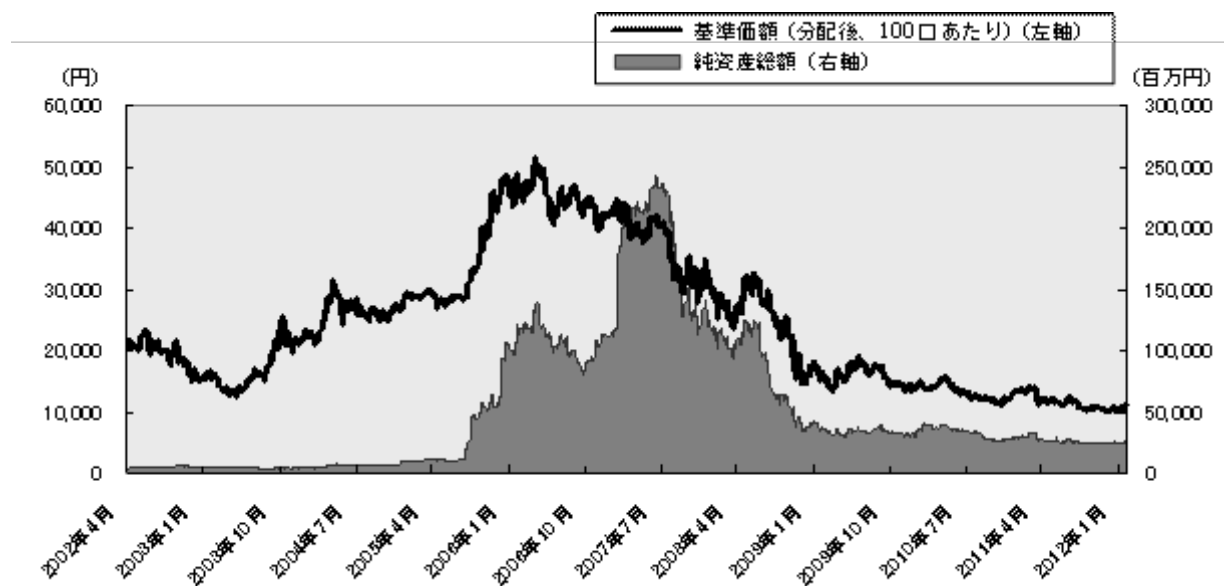
(4)設定及び解約の実績

| 期 | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 第1期 | 30,047,500 | | 30,047,500 |
| 第2期 | 10,018,500 | 14,957,991 | 25,108,009 |
| 第3期 | 14,993,700 | 4,976,132 | 35,125,577 |
| 第4期 | 314,903,200 | 109,822,479 | 240,206,298 |
| 第5期 | 409,972,200 | 74,859,216 | 575,319,282 |
| 第6期 | 40,001,200 | 278,658,729 | 336,661,753 |
| 第7期 | 24,986,500 | 163,838,232 | 197,810,021 |
| 第8期 | 109,964,800 | 44,542,293 | 263,232,528 |
| 第9期 | 49,965,600 | 98,519,937 | 214,678,191 |
| 第10期(中間期) | 14,996,900 | 4,909,765 | 224,765,326 |

本邦外における設定及び解約の実績はありません。
交換口数を表示しております。

< 参考情報 > 運用実績（2012年1月31日現在）

[基準価額・純資産の推移]（日次：設定来）



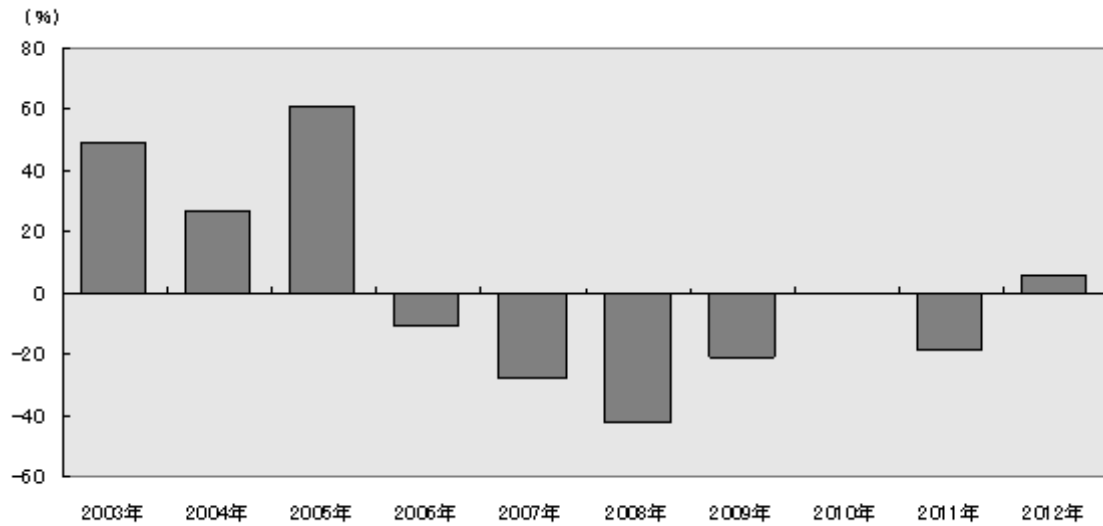
[分配の推移]（100口あたり、課税前）

| | |
|---------|---------|
| 2011年7月 | 347 円 |
| 2010年7月 | 305 円 |
| 2009年7月 | 360 円 |
| 2008年7月 | 418 円 |
| 2007年7月 | 188 円 |
| 設定来累計 | 2,042 円 |

[主要な資産の状況]

| 銘柄別投資比率(上位) | | | |
|-------------|-------------------|-----|----------|
| 順位 | 銘柄 | 業種 | 投資比率 (%) |
| 1 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 26.1 |
| 2 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 18.1 |
| 3 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 14.6 |
| 4 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 銀行業 | 4.6 |
| 5 | りそなホールディングス | 銀行業 | 2.9 |
| 6 | 静岡銀行 | 銀行業 | 2.3 |
| 7 | 横浜銀行 | 銀行業 | 2.2 |
| 8 | 千葉銀行 | 銀行業 | 1.8 |
| 9 | ふくおかフィナンシャルグループ | 銀行業 | 1.3 |
| 10 | 常陽銀行 | 銀行業 | 1.3 |

[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2 【管理及び運営】

3 資産管理等の概要

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)その他

(前略)

(f) 金融商品取引所への上場

委託者は、この信託の受益権について、別に定める金融商品取引所に上場申請を行なうものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所に上場されるものとし、

平成23年9月29日現在、「別に定める金融商品取引所」は次の通りです。

東京証券取引所

委託者は、この信託の受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行なう受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとし、

(以下 略)

< 訂正後 >

(5)その他

(前略)

(f) 金融商品取引所への上場

委託者は、この信託の受益権について、別に定める金融商品取引所に上場申請を行なうものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所に上場されるものとし、

平成24年3月29日現在、「別に定める金融商品取引所」は次の通りです。

東京証券取引所

委託者は、この信託の受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行なう受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとし、

(以下 略)

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、以下の中間財務諸表が追加されます。

< 中間財務諸表 >

東証銀行業株価指数連動型上場投資信託

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)(以下「中間財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(平成23年7月16日から平成24年1月15日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

東証銀行業株価指数連動型上場投資信託

(1)中間貸借対照表

| 科目 | 期別 | 第10期中間計算期間末 平成24年1月15日現在 金額(円) |
|-----------------|----|--------------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 412,845,087 |
| 株式 | | 23,204,253,200 |
| 未収利息 | | 3,121 |
| 流動資産合計 | | 23,617,101,408 |
| 資産合計 | | 23,617,101,408 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | | |
| 未払受託者報酬 | | 8,847,017 |
| 未払委託者報酬 | | 18,957,804 |
| その他未払費用 | | 252,712 |
| 流動負債合計 | | 28,057,533 |
| 負債合計 | | 28,057,533 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 44,953,065,200 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 21,364,021,325 |
| (分配準備積立金) | | 1,620,890 |
| 元本等合計 | | 23,589,043,875 |
| 純資産合計 | | 23,589,043,875 |
| 負債純資産合計 | | 23,617,101,408 |

(2)中間損益及び剰余金計算書

| 科目 | 期別 | 第10期中間計算期間 自平成23年7月16日 至平成24年1月15日 金額(円) |
|-----------------------------|----|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | | 397,872,650 |
| 受取利息 | | 91,853 |
| 有価証券売買等損益 | | 2,639,551,224 |
| その他収益 | | 1,505 |
| 営業収益合計 | | 2,241,585,216 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | | 8,847,017 |
| 委託者報酬 | | 18,957,804 |
| その他費用 | | 252,742 |
| 営業費用合計 | | 28,057,563 |
| 営業利益 | | 2,269,642,779 |
| 経常利益 | | 2,269,642,779 |
| 中間純利益 | | 2,269,642,779 |
| 一部交換に伴う中間純利益金額の分配額 | | |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | 18,145,663,742 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 465,593,100 |
| 中間一部交換に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額 | | 465,593,100 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 1,414,307,904 |

| | |
|-----------------------------|----------------|
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額 | 1,414,307,904 |
| 分配金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 21,364,021,325 |

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-----------------------|---|
| 1 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。 |
| 2 費用・収益の計上基準 | (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。 (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 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、平成23年7月16日から平成24年7月15日までとなっております。 なお、当該中間計算期間は、平成23年7月16日から平成24年1月15日までとなっております。 |

(追加情報)

| |
|--|
| 第10期中間計算期間 自 平成23年7月16日 至 平成24年1月15日 |
| 当中間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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 第10期中間計算期間末 平成24年1月15日現在 | |
|--|------------------|
| 1 中間計算期間の末日における受益権の総数 | 224,765,326 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 | 21,364,021,325 円 |
| 3 中間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 | 104.95 円 |
| (100口当たり純資産額) | 10,495 円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 第10期中間計算期間末 平成24年1月15日現在 | |
|-----------------------------|--|
| 1 | <p>中間貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>中間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、中間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</p> <p>(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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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)

1 元本の移動

| 第10期中間計算期間 自 平成23年7月16日 至 平成24年1月15日 | |
|--|------------------|
| 期首元本額 | 42,935,638,200 円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,999,380,000 円 |
| 期中一部交換元本額 | 981,953,000 円 |

2 デリバティブ取引関係

第10期中間計算期間末(平成24年1月15日現在)
該当事項はございません。

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1月31日現在

| | | |
|----------------|----------------|---|
| 資産総額 | 24,077,083,652 | 円 |
| 負債総額 | 110,029,426 | 円 |
| 純資産総額(-) | 23,967,054,226 | 円 |
| 発行済口数 | 219,854,774 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 109.01 | 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8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2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1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 | 749 | 9,479,968 |
| 単位型株式投資信託 | 37 | 258,016 |
| 追加型公社債投資信託 | 18 | 4,637,197 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 合計 | 804 | 14,375,181 |

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7月末現在

(2) 販売会社

| (a)名称 | (b)資本金の額 [*] | (c)事業の内容 |
|-------------------------|------------------------|---------------------------------|
| 野村証券株式会社 | 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。 |
| クレディ・スイス証券株式会社 | 78,100百万円 | |
| ゴールドマン・サックス証券株式会社 | 83,616百万円 | |
| JPモルガン証券株式会社 | 50,275百万円 | |
| ドイツ証券株式会社 | 72,728百万円 | |
| SMBC日興証券株式会社 | 10,000百万円 | |
| パークレイズ・キャピタル証券株式会社 | 32,945百万円 | |
| みずほ証券株式会社 | 125,167百万円 | |
| メリルリンチ日本証券株式会社 | 119,440百万円 | |
| モルガン・スタンレーMUFG証券株式会社 | 126,149百万円 | |
| シティグループ証券株式会社 | 96,307百万円 | |
| B N P パリバ証券株式会社 | 102,025百万円 | |
| エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社 | 3,000百万円 ^{**} | |

* 平成23年7月末現在

** 平成23年10月27日現在

<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1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。 |
| クレディ・スイス証券株式会社 | 78,100百万円 | |
| ゴールドマン・サックス証券株式会社 | 83,616百万円 | |
| JPモルガン証券株式会社 | 50,275百万円 | |
| ドイツ証券株式会社 | 72,728百万円 | |
| SMBC日興証券株式会社 | 10,000百万円 | |
| パークレイズ・キャピタル証券株式会社 | 32,945百万円 | |
| みずほ証券株式会社 | 125,167百万円 | |
| メリルリンチ日本証券株式会社 | 119,440百万円 | |
| モルガン・スタンレーMUFG証券株式会社 | 126,149百万円 | |
| シティグループ証券株式会社 | 96,307百万円 | |
| B N Pパリバ証券株式会社 | 102,025百万円 | |
| エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社 | 3,000百万円 | |

* 平成24年1月末現在

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23年4月1日 至 平成23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21年3月24日付内閣府令第5号により改正されておりますが、第51期事業年度(前事業年度)は、内閣府令第5号改正前の財務諸表等規則に基づき作成しており、第52期事業年度(当事業年度)は、内閣府令第5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21年3月24日付内閣府令第5号により改正されておりますが、第51期事業年度(前事業年度)は改正前、第52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23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 | | 498 |
| 金銭の信託 | | 39,466 |
| 有価証券 | | 1,600 |
| 短期貸付金 | | 168 |
| 未収委託者報酬 | | 8,212 |
| 未収収益 | | 4,942 |
| 繰延税金資産 | | 853 |
| その他 | | 313 |
| 貸倒引当金 | | 6 |
| 流動資産計 | | 56,049 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 1 | 1,687 |
| 無形固定資産 | | 10,049 |
| ソフトウェア | | 10,047 |
| その他 | | 1 |
| 投資その他の資産 | | 22,390 |
| 投資有価証券 | | 6,685 |
| 関係会社株式 | | 14,424 |
| 繰延税金資産 | | 886 |
| その他 | | 393 |
| 貸倒引当金 | | 0 |
| 固定資産計 | | 34,127 |
| 資産合計 | | 90,176 |

| | | 平成23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 | | 5,000 |
| 未払収益分配金 | | 4 |
| 未払償還金 | | 53 |
| 未払手数料 | | 3,570 |
| その他未払金 | 2 | 1,323 |
| 未払費用 | | 7,194 |
| 未払法人税等 | | 723 |
| 賞与引当金 | | 1,463 |
| その他 | | 99 |
| 流動負債計 | | 19,431 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | | 3,251 |
| 時効後支払損引当金 | | 491 |
| その他 | | 5 |
| 固定負債計 | | 3,747 |
| 負債合計 | | 23,179 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | 65,310 |
| 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 | | 36,400 |
| 利益準備金 | | 685 |
| その他利益剰余金 | | 35,715 |
| 別途積立金 | | 24,606 |
| 繰越利益剰余金 | | 11,108 |
| 評価・換算差額等 | | 1,686 |
| その他有価証券評価差額金 | | 1,568 |
| 繰延ヘッジ損益 | | 117 |
| 純資産合計 | | 66,996 |
| 負債・純資産合計 | | 90,176 |

中間損益計算書

| | | 自 平成23年 4月 1日 至 平成23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 | | 41,975 |
| 運用受託報酬 | | 9,087 |
| その他営業収益 | | 67 |
| 営業収益計 | | 51,131 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | | 21,876 |
| 調査費 | | 10,328 |
| その他営業費用 | | 2,150 |
| 営業費用計 | | 34,356 |
| 一般管理費 | 1 | 11,623 |
| 営業利益 | | 5,151 |
| 営業外収益 | 2 | 3,261 |
| 営業外費用 | 3 | 333 |
| 経常利益 | | 8,079 |
| 特別利益 | 4 | 123 |
| 特別損失 | 5 | 69 |
| 税引前中間純利益 | | 8,133 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 1,605 |
| 法人税等調整額 | | 1,229 |
| 中間純利益 | | 5,298 |

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23年 4月 1日 |
|-----------------|---------------|
| | 至 平成23年 9月30日 |
| 株主資本 | |
| 資本金 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 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 | |
| 当期首残高 | 14,077 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 8,267 |
| 中間純利益 | 5,298 |
| 当中間期変動額合計 | 2,968 |
| 当中間期末残高 | 11,108 |
| 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 39,369 |

| | |
|-----------------------|--------|
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 8,267 |
| 中間純利益 | 5,298 |
| 当中間期変動額合計 | 2,968 |
| 当中間期末残高 | 36,400 |
| 株主資本合計 | |
| 当期首残高 | 68,279 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 8,267 |
| 中間純利益 | 5,298 |
| 当中間期変動額合計 | 2,968 |
| 当中間期末残高 | 65,310 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | |
| 当期首残高 | 2,694 |
| 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) | 1,125 |
| 当中間期変動額合計 | 1,125 |
| 当中間期末残高 | 1,568 |
| 繰延ヘッジ損益 | |
| 当期首残高 | 69 |
| 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) | 187 |
| 当中間期変動額合計 | 187 |
| 当中間期末残高 | 117 |
| 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 2,624 |
| 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) | 938 |
| 当中間期変動額合計 | 938 |
| 当中間期末残高 | 1,686 |
| 純資産合計 | |
| 当期首残高 | 70,903 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 8,267 |
| 中間純利益 | 5,298 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額) | 938 |
| 当中間期変動額合計 | 3,906 |
| 当中間期末残高 | 66,996 |

[重要な会計方針]

| | |
|------------------------|---|
| 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> |

| | |
|-------------|--|
| 7 ヘッジ会計の方法 | <p>(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。</p> <p>(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</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> |
| 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。 |

[追加情報]

| | |
|---------------------------|---|
| | 自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日 |
| 会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用 | 当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「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。 |

[注記事項]

中間貸借対照表関係

| | |
|---|----------|
| 平成23年 9月30日現在 | |
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 2,541百万円 |
| 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23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日 | |
|--------------------------------|----------|
| 1 減価償却実施額 | |
| 有形固定資産 | 232百万円 |
| 無形固定資産 | 1,864百万円 |
| 長期前払費用 | 5百万円 |
| 2 営業外収益のうち主要なもの | |
| 受取配当金 | 2,987百万円 |
| 3 営業外費用のうち主要なもの | |
| 支払利息 | 30百万円 |
| 金銭の信託運用損 | 276百万円 |
| 4 特別利益の内訳 | |
| 投資有価証券等売却益 | 34百万円 |
| 株式報酬受入益 | 88百万円 |
| 5 特別損失の内訳 | |
| 投資有価証券売却損 | 26百万円 |
| 投資有価証券等評価損 | 0百万円 |
| 固定資産除却損 | 42百万円 |

中間株主資本等変動計算書関係

| 自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日 | | | | |
|---|-------|------------------|-------------|------------|
| 1 発行済株式に関する事項 | | | | |
| | 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 |
| | 普通株式 | 5,150,693株 | - | - |
| | | | | 当中間会計期間末 |
| | | | | 5,150,693株 |
| 2 配当に関する事項 | | | | |
| 配当金支払額 | | | | |
| 平成23年 7月11日開催の臨時株主総会において、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) 配当財産の種類 | | 野村ホールディングス株式会社株式 | | |
| (2) 配当財産の帳簿価額 | | | 8,267百万円 | |
| (3) 1株当たり配当額 | | | 1,605円12銭 | |
| (4) 基準日 | | | 平成23年 7月19日 | |
| (5) 効力発生日 | | | 平成23年 7月20日 | |

リース取引関係

| 自 平成23年 4月 1日 至 平成23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 | 361百万円 |
| 減価償却累計額相当額 | 310 |
| 中間期末残高相当額 | 50 |
| 未経過リース料中間期末残高相当額 | |
| 1年内 | 47百万円 |
| 1年超 | 6 |
| 合計 | 53 |
| 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 | 43百万円 |
| 減価償却費相当額 | 40 |
| 支払利息相当額 | 1 |
| 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 | 6百万円 |
| 1年超 | 5 |
| 合計 | 12 |

金融商品関係

当中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成23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 | 498 | 498 | - |
| (2)金銭の信託 | 39,466 | 39,466 | - |
| (3)短期貸付金 | 168 | 168 | - |
| (4)未収委託者報酬 | 8,212 | 8,212 | - |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | | | |
| その他有価証券 | 7,544 | 7,544 | - |
| (6)関係会社株式 | 3,064 | 77,011 | 73,947 |
| 資産計 | 58,954 | 132,902 | 73,947 |
| (7)関係会社短期借入金 | 5,000 | 5,000 | - |
| (8)未払金 | 4,952 | 4,952 | - |
| 未払収益分配金 | 4 | 4 | - |
| 未払償還金 | 53 | 53 | - |
| 未払手数料 | 3,570 | 3,570 | - |
| その他未払金 | 1,323 | 1,323 | - |
| (9)未払費用 | 7,194 | 7,194 | - |
| (10)未払法人税等 | 723 | 723 | - |
| 負債計 | 17,869 | 17,869 | - |
| (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 | 5 | 5 | - |
| デリバティブ取引計 | 5 | 5 | - |

（*）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740百万円、関係会社株式11,360百万円）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23年9月30日）

1．満期保有目的の債券(平成23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23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 | 77,011 | 73,947 |
| 合計 | 3,064 | 77,011 | 73,947 |

3．その他有価証券(平成23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 | 3,356 | 282 | 3,073 |
| 投資信託 | - | - | - |
| 小計 | 3,356 | 282 | 3,073 |
| 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) | 2,587 | 3,003 | 415 |
| 譲渡性預金 | 1,600 | 1,600 | - |
| 小計 | 4,187 | 4,603 | 415 |
| 合計 | 7,544 | 4,885 | 2,658 |

- (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117百万円（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23年 4月 1日 至 平成23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 | 契約額等のうち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 | 2,575 | - | 5 | 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 | 168 | - | (*1) - | - |
| 合 計 | | | 2,743 | - | (*1) 5 | - |

(*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23年 4月 1日 至 平成23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。

1 株当たり情報

| 自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月30日 | |
|--|------------|
| 1 株当たり純資産額 | 13,007円36銭 |
| 1 株当たり中間純利益 | 1,028円70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 | 5,298百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式に係る中間純利益 | 5,298百万円 |
| 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23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 内田 満雄指定有限責任社員
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23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成23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23年4月1日から平成23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。

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) 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。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年2月28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 内田 満 雄指定有限責任社員
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」に掲げられている東証銀行業株価指数連動型上場投資信託の平成23年7月16日から平成24年1月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東証銀行業株価指数連動型上場投資信託の平成24年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年7月16日から平成24年1月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

2. 中間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](#)