【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5月24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】	野村グローバル・ロング・ショート
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	(1)当初申込期間(平成23年11月14日から平成23年11月24日まで) 100億円を上限とします。 (2)継続申込期間(平成23年11月25日から平成24年11月29日まで) 3,000億円を上限とします。 ＊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10月28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）

<u>委託会社の概況</u>

■委託会社■

（前略）

・資本金の額

平成<u>23</u>年<u>9</u>月末現在、17,180百万円

・会社の沿革

（中略）

・大株主の状況(平成<u>23</u>年<u>9</u>月末現在)

（以下略）

＜訂正後＞

(3)ファンドの仕組み

（前略）

<u>委託会社の概況</u>

■委託会社■

（前略）

・資本金の額

平成<u>24</u>年<u>4</u>月末現在、17,180百万円

・会社の沿革

（中略）

・大株主の状況(平成<u>24</u>年<u>4</u>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＞

(1)投資方針

（前略）

[2]有価証券先物取引等および為替予約取引等の実質的な活用に当たっては、Global Tactical Asset Allocation（グローバルな戦術的資産配分。GTAA）モデル及びTactical Currency Allocation（戦術的通貨配分。TCA）モデルに基づき、市場データの精緻な分析により、推定される均衡水準（「各投資対象の均衡水準」※1）から時価が乖離している資産・通貨に係るデリバティブ等を売買し、時価が均衡水準に収斂する過程での収益を獲得することを目指します。

（注）Global Tactical Asset Allocation（GTAA）モデル及びTactical Currency Allocation（TCA）モデルは、ファースト・クオドラント社の開発した運用モデルです。

※1 上記の「各投資対象の均衡水準」とは、ＧＴＡＡモデルおよびＴＣＡモデルを活用し独自に推計した、各投資対象の適正と考えられる価格水準のことをいいます。

[3]実質的な資産配分については、世界主要国の株式・債券市場の中から流動性が高いと判断される市場を対象に、均衡水準（「投資ユニバースにおける均衡水準」※2）より割安と判断される資産に係る有価証券先物取引等の買い建てによるロング・ポジションを、均衡水準より割高と判断される資産に係る有価証券先物取引等の売り建てによるショート・ポジションを構築し、収益の獲得を目指すことを基本とします。

※2 上記の「投資ユニバースにおける均衡水準」とは、各投資対象の割安度合い（魅力度）の平均値のことをいいます。

（中略）

（参考情報）

委託会社が、マザーファンドでの資産配分において対象としている株式・債券市場および通貨配分における対象通貨ならびに資産配分・通貨配分において目途としている制約条件は、平成23年10月現在、以下の通りとなっております。

なお、下記はあくまでも平成23年10月現在の、対象や制約条件であり、モデルの改良や市場の流動性等の要因により今後変更となる場合があります。また、運用上目途としている上限・下限ですので、資金動向、市況動向等により上限・下限の範囲または値を一時的に超えることもあります。

（以下略）

＜訂正後＞

(1)投資方針

（前略）

[2]有価証券先物取引等および為替予約取引等の実質的な活用に当たっては、Global Tactical Asset Allocation（グローバルな戦術的資産配分。GTAA）モデル及びTactical Currency Allocation（戦術的通貨配分。TCA）モデルに基づき、市場データの精緻な分析により、推定される均衡水準（「各投資対象の均衡水準」※1）から時価が乖離している資産・通貨に係るデリバティブ等を売買し、時価が均衡水準に収斂する過程での収益を獲得することを目指します。

（注）Global Tactical Asset Allocation（GTAA）モデル及びTactical Currency Allocation（TCA）モデルは、ファースト・クオドラント社の開発した運用モデルです。

※1 「各投資対象の均衡水準」とは、ＧＴＡＡモデルおよびＴＣＡモデルを活用し独自に推計

した、各投資対象の適正と考えられる価格水準のことをいいます。

[3]実質的な資産配分については、世界主要国の株式・債券市場の中から流動性が高いと判断される市場を対象に、均衡水準（「投資ユニバースにおける均衡水準」※2）より割安と判断される資産に係る有価証券先物取引等の買い建てによるロング・ポジションを、均衡水準より割高と判断される資産に係る有価証券先物取引等の売り建てによるショート・ポジションを構築し、収益の獲得を目指すことを基本とします。

※2 「投資ユニバースにおける均衡水準」とは、各投資対象の割安度合い（魅力度）の平均値のことをいいます。

（中略）

（参考情報）

委託会社が、マザーファンドでの資産配分において対象としている株式・債券市場および通貨配分における対象通貨ならびに資産配分・通貨配分において目途としている制約条件は、平成24年5月現在、以下の通りとなっております。

なお、下記はあくまでも平成24年5月現在の、対象や制約条件であり、モデルの改良や市場の流動性等の要因により今後変更となる場合があります。また、運用上目途としている上限・下限ですので、資金動向、市況動向等により上限・下限の範囲または値を一時的に超えることもあります。

（以下略）

＜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10月28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5月24日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜訂正前＞

(4)分配方針

（前略）

◆ファンドの決算日

原則として**毎年3月5日**※（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

※初回の決算日は平成24年3月5日となります。

◆分配金のお支払い

（以下略）

＜訂正後＞

(4)分配方針

（前略）

◆ファンドの決算日

原則として**毎年3月5日**（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

◆分配金のお支払い

（以下略）

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10月28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5月24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

（前略）

信託報酬は、毎計算期間（第1計算期間を除きます。）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ファンドから支払われます。

（中略）

(参考)信託報酬等の総額（約款第41条）

（中略）

②上記①の信託報酬は、毎計算期間（第1計算期間を除きます。）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中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

（以下略）

＜訂正後＞

(3)信託報酬等

（前略）

信託報酬は、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ファンドから支払われます。

（中略）

(参考)信託報酬等の総額（約款第41条）

（中略）

②上記①の信託報酬は、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中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

（以下略）

＜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（配当控除は適用されません。）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、益金不算入制度は適用されません。

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。

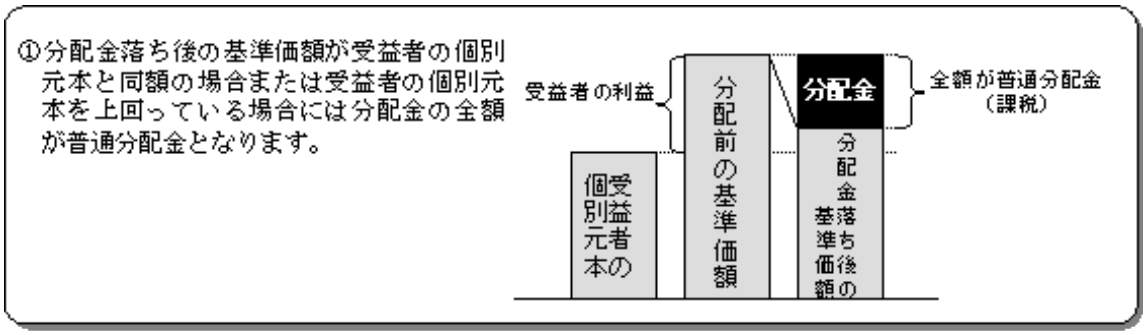
■個別元本について■

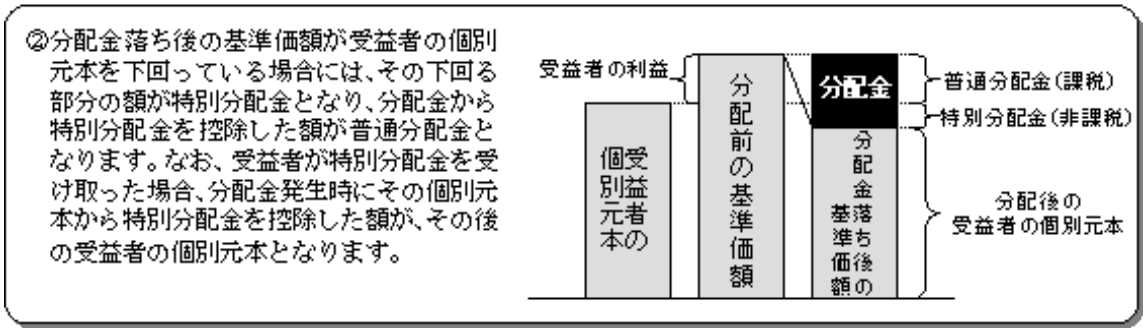
◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

◆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	0.1%※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0.1%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などには、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（配当控除は適用されません。）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(配当控除は適用されません。)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、益金不算入制度は適用されません。

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。

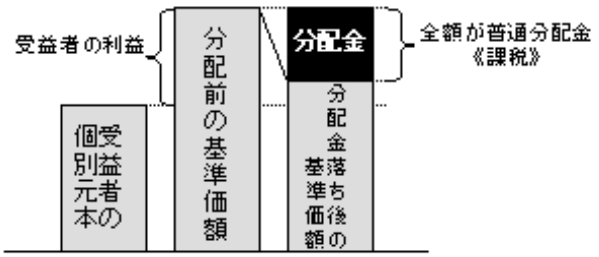
◆受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

■分配金の課税について■

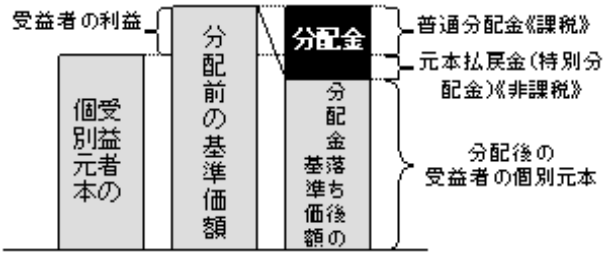
◆分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」

(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。

①分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額の場合または受益者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。



②分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。



※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	0.1%※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0.1%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などには、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3月30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	136,804,156	99.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,035,645	0.75
合計(純資産総額)		137,839,801	100.00

＜ご参考＞
「グローバル・アセット・モデル・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(%)
現金・預金・その他の資産※(負債控除後)	―	20,026,695,824	100.00
合計(純資産総額)		20,026,695,824	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	10	81,226,300	85,700,000	0.42
長期国債先物(6%、10年)(2012年6月限)	東京証券取引所	債券先物	売建	円	30	4,259,908,500	4,260,300,000	21.27

※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。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

名称	取引所	種類	買建／売建	通貨	枚数	簿価(現地通貨)	評価額(時価・現地通貨)	評価額(時価・円)	投資比率(%)
S&P500株価指数先物(2012年6月限)	シカゴ・マーカンタイル取引所	株価指数先物	買建	米ドル	17	5,808,900	5,942,350	488,401,746	2.43
S&P TSX60株価指数先物(2012年6月限)	モントリオール取引所	株価指数先物	買建	カナダドル	58	8,126,960	8,180,320	675,040,006	3.37
DAX株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数先物	買建	ユーロ	40	7,051,000	6,893,000	756,851,400	3.77
FTSE MIB株価指数先物(2012年6月限)	イタリア証券取引所	株価指数先物	買建	ユーロ	17	1,413,550	1,333,650	146,434,770	0.73
SPI200株価指数先物(2012年6月限)	シドニー先物取引所	株価指数先物	売建	豪ドル	73	7,871,225	7,920,500	676,806,725	3.37
FTI100株価指数先物(2012年6月限)	ロンドン国際金融先物取引所	株価指数先物	買建	英ポンド	145	8,607,200	8,254,850	1,084,191,999	5.41
SMI株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数先物	買建	スイスフラン	253	15,650,580	15,362,160	1,398,878,289	6.98
ハンセン株価指数先物(2012年4月限)	香港先物取引所	株価指数先物	売建	香港ドル	21	22,061,550	21,569,100	228,201,078	1.13
IBEX35株価指数先物(2012年4月限)	マドリード証券取引所	株価指数先物	買建	ユーロ	89	7,428,830	6,967,365	765,016,677	3.81
AEX株価指数先物(2012年4月限)	Euronext	株価指数先物	買建	ユーロ	193	12,795,514	12,336,560	1,354,554,288	6.76
CAC40-EURO10株価指数先物(2012年4月限)	Euronext	株価指数先物	買建	ユーロ	112	3,985,520	3,784,480	415,535,904	2.07
T-NOTE先物(10年)(2012年6月限)	シカゴ・ボード・オブ・トレード	債券先物	売建	米ドル	871	114,182,656.25	113,148,343.75	9,299,662,372	46.43
カナダ10年国債先物(2012年6月限)	モントリオール取引所	債券先物	売建	カナダドル	58	7,696,600	7,629,900	629,619,348	3.14
BUNDS先物(2012年6月限)	EUREX	債券先物	買建	ユーロ	1,053	145,485,000	145,640,430	15,991,319,214	79.85
オーストラリア10年国債先物(2012年6月限)	シドニー先物取引所	債券先物	売建	豪ドル	1,800	208,146,510	208,627,650	17,827,232,692	89.01
GILT先物(2012年6月限)	ロンドン国際金融先物取引所	債券先物	買建	英ポンド	648	74,610,720	74,144,160	9,738,093,974	48.62

(2)投資資産

①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	グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド	101,044,506	1.3596	137,386,262	1.3539	136,804,156	99.24

＜ご参考＞
「グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド」
該当事項はありません。

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	―	99.24
合計		99.24

＜ご参考＞
「グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド」
該当事項はありません。

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③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＞
「グローバル・アセット・モデル・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	10	81,226,300	85,700,000	0.42
長期国債先物(6%、10年)(2012年6月限)	東京証券取引所	債券先物	売建	円	30	4,259,908,500	4,260,300,000	21.27

※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。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

名称	取引所	種類	買建／売建	通貨	枚数	簿価(現地通貨)	評価額(時価・現地通貨)	評価額(時価・円)	投資比率(%)
S&P500株価指数先物(2012年6月限)	シカゴ・マーカンタイル取引所	株価指数先物	買建	米ドル	17	5,808,900	5,942,350	488,401,746	2.43
S&P TSX60株価指数先物(2012年6月限)	モントリオール取引所	株価指数先物	買建	カナダドル	58	8,126,960	8,180,320	675,040,006	3.37

DAX株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数先物	買建	ユーロ	40	7,051,000	6,893,000	756,851,400	3.77
FTSE MIB株価指数先物(2012年6月限)	イタリア証券取引所	株価指数先物	買建	ユーロ	17	1,413,550	1,333,650	146,434,770	0.73
SPI200株価指数先物(2012年6月限)	シドニー先物取引所	株価指数先物	売建	豪ドル	73	7,871,225	7,920,500	676,806,725	3.37
FTI100株価指数先物(2012年6月限)	ロンドン国際金融先物取引所	株価指数先物	買建	英ポンド	145	8,607,200	8,254,850	1,084,191,999	5.41
SMI株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数先物	買建	スイスフラン	253	15,650,580	15,362,160	1,398,878,289	6.98
ハンセン株価指数先物(2012年4月限)	香港先物取引所	株価指数先物	売建	香港ドル	21	22,061,550	21,569,100	228,201,078	1.13
IBEX35株価指数先物(2012年4月限)	マドリード証券取引所	株価指数先物	買建	ユーロ	89	7,428,830	6,967,365	765,016,677	3.81
AEX株価指数先物(2012年4月限)	Euronext	株価指数先物	買建	ユーロ	193	12,795,514	12,336,560	1,354,554,288	6.76
CAC40-EURO10株価指数先物(2012年4月限)	Euronext	株価指数先物	買建	ユーロ	112	3,985,520	3,784,480	415,535,904	2.07
T-NOTE先物(10年)(2012年6月限)	シカゴ・ボード・オブ・トレード	債券先物	売建	米ドル	871	114,182,656.25	113,148,343.75	9,299,662,372	46.43
カナダ10年国債先物(2012年6月限)	モントリオール取引所	債券先物	売建	カナダドル	58	7,696,600	7,629,900	629,619,348	3.14
BUNDS先物(2012年6月限)	EUREX	債券先物	買建	ユーロ	1,053	145,485,000	145,640,430	15,991,319,214	79.85
オーストラリア10年国債先物(2012年6月限)	シドニー先物取引所	債券先物	売建	豪ドル	1,800	208,146,510	208,627,650	17,827,232,692	89.01
GILT先物(2012年6月限)	ロンドン国際金融先物取引所	債券先物	買建	英ポンド	648	74,610,720	74,144,160	9,738,093,974	48.62

(3)運用実績

①純資産の推移

平成24年3月末日及び同日前1年以内における各月末(設定来)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1期　(2012年3月5日)	104	104	1.0770	1.0780
2011年11月末日	38	―	0.9980	―
12月末日	63	―	1.0176	―
2012年1月末日	73	―	1.0084	―
2月末日	97	―	1.0613	―
3月末日	137	―	1.0701	―

②分配の推移

期	1口当たりの分配金
第1期	0.0010　円

③収益率の推移

期	収益率
第1期	7.8　%

※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。

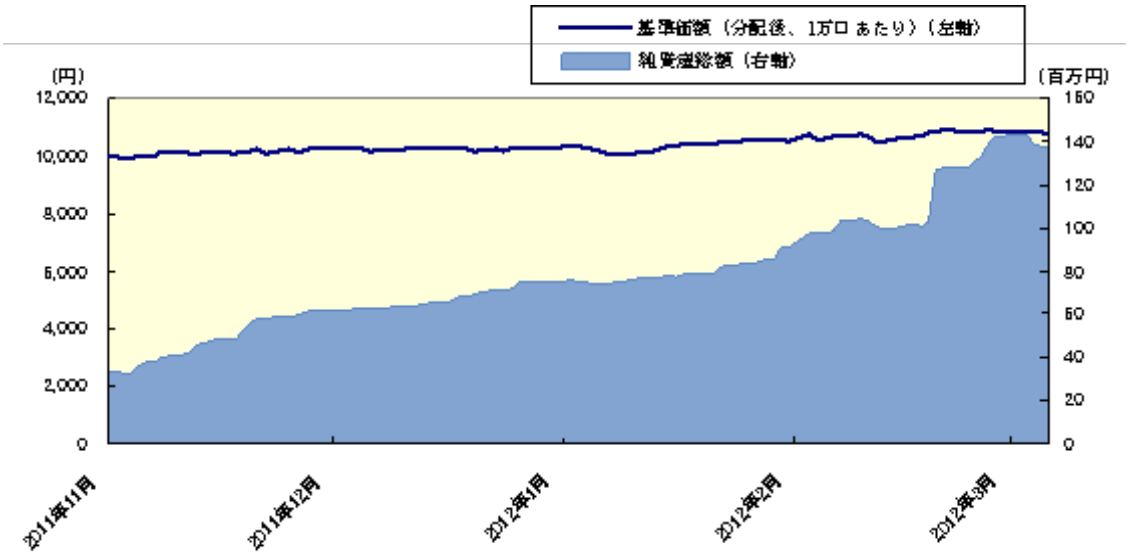
(4)設定及び解約の実績

期	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1期	111,870,452	14,842,816	97,027,636

※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3月30日現在）

［基準価額・純資産の推移］ （日次：設定来）



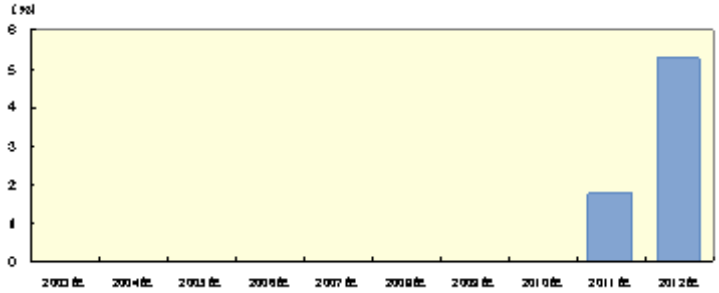
［分配の推移］ （1万口あたり、課税前）

2012年3月	10 円
--	--
--	--
--	--
--	--
設定来累計	10 円

［主要な資産の状況］

投資比率	
銘柄/資産の種類	投資比率（%）
グローバル・アセット・モデル・ファンド　マザーファンド	99.2
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	0.8

［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。
・ファンドは、日本円１ヵ月LIBORをベンチマークとしておりますが、株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引等を積極的に活用し、投資対象市場の方向性によらず収益の獲得を目指す運用を行うことから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるため掲載はしておりません。
・2011年は設定日（2011年11月25日）から年末までの収益率。
・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＞

（４）計算期間

原則として、毎年3月6日から翌年3月5日までとします。

ただし、第１計算期間は平成23年11月25日から平成24年3月5日までとします。

また、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。なお、最終計算期間は、平成29年3月6日までとします。

＜訂正後＞

（４）計算期間

原則として、毎年3月6日から翌年3月5日までとします。

また、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。なお、最終計算期間は、平成29年3月6日までとします。

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＞

野村グローバル・ロング・ショート

（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1期計算期間(平成23年11月25日から平成24年 3 月 5 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

野村グローバル・ロング・ショート

(1)貸借対照表

期別	第1期 平成24年 3 月 5 日現在
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,780,562
親投資信託受益証券	103,501,380
未収利息	7
流動資産合計	106,281,949
資産合計	106,281,949
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	97,027
未払解約金	34,078
未払受託者報酬	9,834
未払委託者報酬	1,639,965
その他未払費用	561
流動負債合計	1,781,465
負債合計	1,781,465
純資産の部	
元本等	
元本	97,027,636
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,472,848
(分配準備積立金)	5,496,666
元本等合計	104,500,484
純資産合計	104,500,484
負債純資産合計	106,281,949

(2)損益及び剰余金計算書

期別	第1期 自 平成23年11月25日 至 平成24年 3 月 5 日
科目	金額(円)
営業収益	
受取利息	295
有価証券売買等損益	7,466,380
営業収益合計	7,466,675
営業費用	
受託者報酬	9,834
委託者報酬	1,639,965
その他費用	561
営業費用合計	1,650,360
営業利益	5,816,315
経常利益	5,816,315
当期純利益	5,816,315
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	222,622
期首剰余金又は期首欠損金(△)	―
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,095,636
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,095,636
剰余金減少額又は欠損金増加額	119,454
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	119,454
分配金	97,027
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,472,848

(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、平成23年11月25日(設定日)から平成24年 3 月 5 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成24年 3 月 5 日現在	
1 計算期間の末日における受益権の総数	97,027,636 口
2 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0770 円
(10,000口当たり純資産額	10,770 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期
自 平成23年11月25日
至 平成24年 3 月 5 日

1 分配金の計算過程
計算期末における分配対象金額7,569,875円(10,000口当たり780円)のうち、97,027円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	29,894 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	5,563,799 円
収益調整金額	C	1,976,182 円
分配準備積立金額	D	― 円
当ファンドの分配対象収益額	E＝A+B+C+D	7,569,875 円
当ファンドの期末残存口数	F	97,027,636 口
10,000口当たり収益分配対象額	G＝E/F×10,000	780 円
10,000口当たり分配金額	H	10 円
収益分配金金額	I＝F×H/10,000	97,027 円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第1期
自 平成23年11月25日
至 平成24年 3 月 5 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、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、金利変動リスク、為替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。

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なっております。
○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なっております。
○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なっております。
○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なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期
平成24年 3 月 5 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
○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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 平成23年11月25日 至 平成24年 3 月 5 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。

(その他の注記)

１元本の移動

第1期 自 平成23年11月25日 至 平成24年 3 月 5 日	
期首元本額	― 円
期中追加設定元本額	111,870,452 円
期中一部解約元本額	14,842,816 円

２有価証券関係

売買目的有価証券

	第1期 自 平成23年11月25日 至 平成24年 3 月 5 日
種類	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	7,407,614
合計	7,407,614

３デリバティブ取引関係

第1期(平成24年 3 月 5 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 5 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 5 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	グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド		103,501,380	
親投資信託受益証券計	銘柄数：1		103,501,380	
	組入時価比率：99.0%		100%	
合計			103,501,380	

(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「グローバル・アセット・モデル・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 「グローバル・アセット・モデル・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 5 日現在
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	548,883,130
派生商品評価勘定	2,075,543,296
現先取引勘定	14,999,100,000
未収入金	24,997,965
未収利息	1,402
差入委託証拠金	3,307,369,712
流動資産合計	20,955,895,505
資産合計	20,955,895,505
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	654,007,320
未払金	91,660,280
流動負債合計	745,667,600
負債合計	745,667,600
純資産の部	
元本等	
元本	14,910,738,877
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	5,299,489,028
元本等合計	20,210,227,905
純資産合計	20,210,227,905
負債純資産合計	20,955,895,505

(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	(１) 先物取引 国内先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 外国先物の評価においては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 (２) 外国為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2　外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3　費用・収益の計上基準	(１) 派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。
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。
5　その他	(１) 現先取引 現先取引の会計処理については、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準委員会　平成20年3月10日)の規定によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成24年 3 月 5 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	1.3554 円
(10,000口当たり純資産額	13,554 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11月25日
至　平成24年 3 月 5 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、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。
これらは、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。
なお、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスク及び為替変動リスクを有しております。
当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行なっております。当該デリバティブ取引は、対象とする債券・金利等に係る価格変動リスク及び為替変動リスクを有しております。
また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。

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なっております。
○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なっております。
○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なっております。
○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なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成24年 3 月 5 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
○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24年 3 月 5 日現在

1 元本の移動及び期末元本額の内訳

期首(設定日)	平成23年11月25日
期首元本額	15,937,399,877 円
期首より平成24年 3 月 5 日までの期中追加設定元本額	270,022,797 円
期首より平成24年 3 月 5 日までの期中一部解約元本額	1,296,683,797 円
期末元本額	14,910,738,877 円
期末元本額の内訳＊	
野村ファンドラップ オルタナティブ グローバル・アセット・モデル	1,722,811,620 円
野村グローバル・アセット・モデル・ファンド(野村SMA向け)	664,787,738 円
野村グローバル・ロング・ショート	76,362,240 円
野村FQグローバルLS(非課税適格機関投資家専用)	7,451,895,998 円
グローバル・アセット・モデル・ファンドF(適格機関投資家専用)	1,077,929,125 円
野村FQグローバルLS mid(非課税適格機関投資家専用)	3,916,952,156 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 5 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 5 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 5 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				
国内株価指数先物取引				
買建	83,700,000	―	83,150,000	△556,300
外国株価指数先物取引				
買建	7,220,105,549	―	7,620,331,157	400,225,608
売建	900,953,116	―	920,859,655	△19,906,539
国内債券先物取引				
買建	284,740,000	―	285,180,000	437,900
外国債券先物取引				
買建	23,425,915,159	―	23,940,902,876	514,987,717
売建	31,410,197,250	―	30,971,008,660	439,188,590
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	30,828,052,200	―	31,491,473,000	663,420,800
米ドル	9,733,980,000	―	9,978,860,000	244,880,000
英ポンド	8,621,820,000	―	8,824,968,000	203,148,000
スウェーデンクローナ	6,645,158,000	―	6,807,645,000	162,487,000
ニュージーランドドル	5,827,094,200	―	5,880,000,000	52,905,800
売建	24,554,269,200	―	25,130,531,000	△576,261,800
カナダドル	3,410,796,000	―	3,477,060,000	△66,264,000
スイスフラン	11,564,350,000	―	11,875,570,000	△311,220,000
ユーロ	2,343,730,000	―	2,400,595,000	△56,865,000
香港ドル	114,912,000	―	117,712,000	△2,800,000
豪ドル	7,120,481,200	―	7,259,594,000	△139,112,800
合計	―	―	―	1,421,535,976

(注)時価の算定方法
１先物取引
A. 国内先物取引について
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。
B. 外国先物取引について
先物取引の評価においては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２ 為替予約取引
1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
①計算期間末日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
②計算期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
2)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※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3月30日現在

Ⅰ	資産総額	138,549,244	円
Ⅱ	負債総額	709,443	円
Ⅲ	純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	137,839,801	円
Ⅳ	発行済口数	128,807,727	口
Ⅴ	1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.0701	円

＜ご参考＞
「グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド」

Ⅰ	資産総額	78,256,323,824	円
Ⅱ	負債総額	58,229,628,000	円
Ⅲ	純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	20,026,695,824	円
Ⅳ	発行済口数	14,792,163,610	口
Ⅴ	1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.3539	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9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

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8月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額＊	(c)事業の内容
株式会社ＳＢＩ証券	47,937百万円	「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。
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
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んでいます。

＊平成23年8月末現在

＜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
株式会社ＳＢＩ証券	47,937百万円	「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。
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
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んでいます。

＊平成24年3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		65,310
資本金		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	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
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	(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。 (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。
5　引当金の計上基準	(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。 (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。 (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。 (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。
6　リース取引の処理方法	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。

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。

[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	当中間会計期間末
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)

① 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

② 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

③ 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

④ 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。

⑤ 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

① 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。

② 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が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に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 監 査 報 告 書

平成24年4月18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」に掲げられている野村グローバル・ロング・ショートの平成23年11月25日から平成24年3月5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、野村グローバル・ロング・ショートの平成24年3月5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。

次へ