

平成25年9月末  
連結自己資本規制比率に関する開示  
(経営の健全性の状況)

〔金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が経営の健全性の状況を記載した書面に記載すべき事項を定める件（平成22年金融庁告示第132号）に基づき行う開示〕

事業年度 自平成25年4月1日  
(第110期) 至平成25年9月30日

野村ホールディングス株式会社

金融商品取引業等に関する内閣府令(平成 19 年内閣府令第 52 号)第 208 条の 28 第 1 項の規定に基づき、金融庁長官が定める場合及び金融商品取引法(昭和 23 年法律第 25 号)第 57 条の 17 第 2 項および第 3 項の経営の健全性の状況を記載した書面に記載すべき事項について以下記します。なお、本書面において使用する用語は、最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準を定める件(平成 22 年金融庁告示第 130 号。以下「連結自己資本規制比率告示」といいます。)において使用する用語の例によります。

## 目次

|     |  |    |
|-----|--|----|
| 第1部 | 自己資本の構成に関する開示事項  | 3  |
| 第2部 | 定性的な開示事項   | 7  |
| 1.  | 連結の範囲  | 7  |
| 2.  | 連結自己資本規制比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表に関する事項                 | 8  |
| 第3部 | 定量的な開示事項   | 9  |
| 1.  | その他金融機関等であって、最終指定親会社の子法人等であるものの自己資本                                      | 9  |
| 2.  | 連結自己資本規制比率に関する事項   | 9  |
| 3.  | 自己資本の充実度に関する事項   | 10 |
| 4.  | 信用リスク(信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー及び証券化エクスポージャーを除く。)に関する事項             | 11 |
| 5.  | 信用リスク削減手法に関する事項  | 16 |
| 6.  | 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する事項  | 16 |
| 7.  | 会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャーに関する事項                 | 17 |
| 8.  | マーケット・リスクに関する事項  | 18 |
| 9.  | トレーディング業務以外の出資等又は株式等エクスポージャーに関する事項                                       | 20 |
| 10. | トレーディング業務以外の取引から生じる金利リスクに関して会社グループが内部管理上使用した金利ショックに対する損益又は経済的価値の増減に関する事項 | 20 |
| 第4部 | 自己資本調達手段に関する契約内容   | 21 |
| 1.  | 野村ホールディングス株式会社 普通株式  | 21 |
| 2.  | 野村ホールディングス株式会社 第1回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約及び条件付債務免除特約付)                        | 22 |
| 3.  | 野村ホールディングス株式会社 第2回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約及び条件付債務免除特約付)                        | 25 |
| 4.  | 野村ホールディングス株式会社 第2回無担保社債(劣後特約付)   | 28 |
| 5.  | 野村ホールディングス株式会社 第3回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)                                   | 30 |
| 6.  | 野村ホールディングス株式会社 第4回期限前償還条項付無担保変動利付社債(劣後特約付)                               | 32 |
| 7.  | 野村ホールディングス株式会社 第5回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)                                   | 34 |
| 8.  | 野村証券株式会社 第3回無担保社債(劣後特約付)   | 36 |
| 9.  | 野村証券株式会社 劣後特約付借入金  | 38 |
| 10. | 野村証券株式会社 劣後特約付借入金  | 39 |

## 第1部 自己資本の構成に関する開示事項

(単位：百万円、%)

| 項目   | 平成25年6月末  |             | 平成25年9月末  |             | 国際様式の該当番号  |
|--|-----------|-------------|-----------|-------------|------------|
|  |           | 経過措置による不算入額 |           | 経過措置による不算入額 |            |
| <b>普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目 (1)</b>                |           |             |           |             |            |
| 普通株式に係る株主資本の額                                  | 2,371,308 |             | 2,392,372 |             | 1a+2-1c-26 |
| うち、資本金及び資本剰余金の額                                | 1,275,350 |             | 1,276,541 |             | 1a         |
| うち、利益剰余金の額                                     | 1,178,908 |             | 1,195,482 |             | 2          |
| うち、自己株式の額 (△)                                  | 82,950    |             | 79,651    |             | 1c         |
| うち、社外流出予定額 (△)                                 | -         |             | -         |             | 26         |
| うち、上記以外に該当するものの額                               | -         |             | -         |             |            |
| 普通株式に係る新株予約権の額                                 | -         |             | -         |             | 1b         |
| その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額                        | -         | 34,026      | -         | 39,189      | 3          |
| 普通株式等Tier1 資本に係る調整後少数株主持分の額                    | -         |             | -         |             | 5          |
| 経過措置により普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額    | -         |             | -         |             |            |
| 普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額 (イ)                     | 2,371,308 | 34,026      | 2,392,372 | 39,189      | 6          |
| <b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目 (2)</b>                |           |             |           |             |            |
| 無形固定資産 (モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額       | -         | 214,759     | -         | 208,883     | 8+9        |
| うち、のれんに係るもの (のれん相当差額を含む。)の額                    | -         | 77,593      | -         | 75,102      | 8          |
| うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額           | -         | 137,166     | -         | 133,781     | 9          |
| 繰延税金資産 (一時差異に係るものを除く。)の額                       | -         | 13,089      | -         | 12,959      | 10         |
| 繰延ヘッジ損益の額                                      | -         | -           | -         | -           | 11         |
| 適格引当金不足額                                       | -         | 59,144      | -         | 56,821      | 12         |
| 証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額                         | -         | -           | -         | -           | 13         |
| 負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額             | -         | 47,461      | -         | 36,318      | 14         |
| 前払年金費用の額                                       | -         | 9,127       | -         | 9,437       | 15         |
| 自己保有普通株式 (純資産の部に計上されるものを除く)の額                  | -         | 939         | -         | 625         | 16         |
| 意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額                       | -         | -           | -         | -           | 17         |
| 少数出資金融機関等の普通株式の額                               | -         | -           | -         | -           | 18         |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                             | -         | -           | -         | -           | 19+20+21   |
| うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額  | -         | -           | -         | -           | 19         |
| うち、無形固定資産 (モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額 | -         | -           | -         | -           | 20         |
| うち、繰延税金資産 (一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額             | -         | -           | -         | -           | 21         |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                            | -         | -           | -         | -           | 22         |
| うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額  | -         | -           | -         | -           | 23         |
| うち、無形固定資産 (モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額 | -         | -           | -         | -           | 24         |
| うち、繰延税金資産 (一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額             | -         | -           | -         | -           | 25         |
| その他Tier1 資本不足額                                 | 216,278   |             | 205,537   |             | 27         |
| 普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)                     | 216,278   | 344,518     | 205,537   | 325,044     | 28         |

| 項目  | 平成25年6月末 |             | 平成25年9月末 |             | 国際様式の該当番号 |
|---|----------|-------------|----------|-------------|-----------|
|   |          | 経過措置による不算入額 |          | 経過措置による不算入額 |           |
| <b>普通株式等Tier1 資本</b>                                |          |             |          |             |           |
| 普通株式等Tier1 資本の額（イ）－（ロ）                              | (ハ)      | 2,155,029   |          | 2,186,835   | 29        |
| <b>その他Tier1 資本に係る基礎項目（3）</b>                        |          |             |          |             |           |
| その他Tier1 資本調達手段に係る株主資本の額                            |          | -           |          | -           | 31a       |
| その他Tier1 資本調達手段に係る新株予約権の額                           |          | -           |          | -           | 31b       |
| その他Tier1 資本調達手段に係る負債の額                              |          | -           |          | -           | 32        |
| 特別目的会社等の発行するその他Tier1 資本調達手段の額                       |          | -           |          | -           |           |
| その他Tier1 資本調達手段に係る調整後少数株主持分等の額                      |          | -           |          | -           | 34-35     |
| 適格旧Tier1 資本調達手段の額のうちその他Tier1 資本に係る基礎項目の額に含まれる額      |          | -           |          | -           | 33+35     |
| うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特定目的会社等の発行する資本調達手段の額            |          | -           |          | -           | 33        |
| うち、最終指定親会社の連結子法人等（最終指定親会社の特別目的会社等を除く。）の発行する資本調達手段の額 |          | -           |          | -           | 35        |
| 経過措置によりその他Tier1 資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額           |          | 34,026      |          | 39,189      |           |
| うち、その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額                          |          | 34,026      |          | 39,189      |           |
| その他Tier1 資本に係る基礎項目の額                                | (ニ)      | 34,026      |          | 39,189      | 36        |
| <b>その他Tier1 資本に係る調整項目</b>                           |          |             |          |             |           |
| 自己保有その他Tier1 資本調達手段の額                               |          | -           | -        | -           | 37        |
| 意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額                 |          | -           | -        | -           | 38        |
| 少数出資金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額                         |          | -           | -        | -           | 39        |
| その他金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額                          |          | -           | 62,852   | -           | 41,652    |
| 経過措置によりその他Tier1 資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額           |          | 182,252     |          | 166,348     |           |
| うち、無形固定資産(のれんに係るものに限る)の額                            |          | 77,593      |          | 75,102      |           |
| うち、無形固定資産(のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く)の額          |          | 27,626      |          | 26,518      |           |
| うち、期待損失額の対適格引当金超過額を2で除した額                           |          | 29,572      |          | 28,410      |           |
| うち、負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額               |          | 47,461      |          | 36,318      |           |
| Tier2 資本不足額   |          | -           |          | -           | 42        |
| その他Tier1 資本に係る調整項目の額                                | (ホ)      | 182,252     | 62,852   | 166,348     | 41,652    |
|   |          |             |          |             | 43        |

| 項目   | 平成25年6月末 |                 | 平成25年9月末 |                 | 国際様式の該<br>当番号 |
|--|----------|-----------------|----------|-----------------|---------------|
|  |          | 経過措置による<br>不算入額 |          | 経過措置による<br>不算入額 |               |
| <b>その他Tier1 資本</b>                                 |          |                 |          |                 |               |
| その他Tier1資本の額（(ニ) - (ホ)）                            | (へ)      | -               |          | -               | 44            |
| <b>Tier1 資本</b>                                    |          |                 |          |                 |               |
| Tier1 資本の額（(ハ) + (へ)）                              | (ト)      | 2,155,029       |          | 2,186,835       | 45            |
| <b>Tier2 資本に係る基礎項目（4）</b>                          |          |                 |          |                 |               |
| Tier2 資本調達手段に係る株主資本の額                              |          | -               |          | -               | 46            |
| Tier2 資本調達手段に係る新株予約権の額                             |          | -               |          | -               |               |
| Tier2 資本調達手段に係る負債の額                                |          | 169,583         |          | 169,690         |               |
| 特別目的会社等の発行するTier2 資本調達手段の額                         |          | -               |          | -               | 48-49         |
| Tier2 資本調達手段に係る調整後少数株主持分等の額                        |          | -               |          | -               |               |
| 適格旧Tier2 資本調達手段の額のうちTier2 資本に係る基礎項目の額に含まれる額        |          | 280,187         |          | 280,115         | 47+49         |
| うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特定目的会社等の発行する資本調達手段の額           |          | 136,980         |          | 136,980         | 47            |
| うち、最終指定親会社の連結子法人等（最終指定親会社の特別目的会社を除く。）の発行する資本調達手段の額 |          | 143,207         |          | 143,135         | 49            |
| 一般貸倒引当金Tier2 算入額及び適格引当金Tier2 算入額の合計                |          | -               |          | -               | 50            |
| うち、一般貸倒引当金Tier2 算入額                                |          | -               |          | -               | 50a           |
| うち、適格引当金Tier2 算入額                                  |          | -               |          | -               | 50b           |
| 経過措置によりTier2 資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額             |          | -               |          | -               |               |
| うち、少数株主持分の額  |          | -               |          | -               |               |
| Tier2 資本に係る基礎項目の額                                  | (チ)      | 449,770         |          | 449,805         | 51            |
| <b>Tier2 資本に係る調整項目</b>                             |          |                 |          |                 |               |
| 自己保有Tier2 資本調達手段の額                                 |          | -               | -        | -               | 52            |
| 意図的に保有している他の金融機関等のTier2 資本調達手段の額                   |          | -               | -        | -               | 53            |
| 少数出資金融機関等のTier2 資本調達手段の額                           |          | -               | -        | -               | 54            |
| その他金融機関等のTier2 資本調達手段の額                            |          | -               | -        | -               | 55            |
| 経過措置によりTier2 資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額             |          | 92,423          |          | 70,062          |               |
| うち、意図的保有の額   |          | -               |          | -               |               |
| うち、他の金融機関等の資本調達手段の額                                |          | 62,852          |          | 41,652          |               |
| うち、期待損失額の対適格引当金超過額を2で除した額                          |          | 29,572          |          | 28,410          |               |
| Tier2 資本に係る調整項目の額                                  | (リ)      | 92,423          |          | 70,062          | 57            |
| <b>Tier2 資本</b>                                    |          |                 |          |                 |               |
| Tier2 資本の額（(チ) - (リ)）                              | (ヌ)      | 357,347         |          | 379,743         | 58            |
| <b>総自己資本</b>                                       |          |                 |          |                 |               |
| 総自己資本合計（(ト) + (ヌ)）                                 | (ル)      | 2,512,376       |          | 2,566,578       | 59            |

| 項目   | 平成25年6月末   |             | 平成25年9月末   |             | 国際様式の該当番号 |
|--|------------|-------------|------------|-------------|-----------|
|  |            | 経過措置による不算入額 |            | 経過措置による不算入額 |           |
| <b>リスク・アセット (5)</b>  |            |             |            |             |           |
| 経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額の合計額  | 132,694    |             | 130,285    |             |           |
| うち、無形固定資産(のれん及びモーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものを除く)の額   | 109,539    |             | 107,263    |             |           |
| うち、繰延税金資産(一時差異に係るものを除く)の額  | 13,089     |             | 12,959     |             |           |
| うち、前払年金費用の額  | 9,127      |             | 9,437      |             |           |
| うち、自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く)の額  | 939        |             | 625        |             |           |
| リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)   | 17,969,398 |             | 17,854,053 |             | 60        |
| <b>連結自己資本規制比率</b>  |            |             |            |             |           |
| 連結普通株式等Tier1 比率 (ハ) / (ヲ)  | 11.9%      |             | 12.2%      |             | 61        |
| 連結Tier1 比率 (ト) / (ヲ)   | 11.9%      |             | 12.2%      |             | 62        |
| 連結総自己資本規制比率 (ル) / (ヲ)  | 13.9%      |             | 14.3%      |             | 63        |
| <b>調整項目に係る参考事項 (6)</b>   |            |             |            |             |           |
| 少数出資金融機関等の対象資本調達手段に係る調整項目不算入額  | 171,395    |             | 176,168    |             | 72        |
| その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額  | 106,839    |             | 112,352    |             | 73        |
| 無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額   | -          |             | -          |             | 74        |
| 繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額   | 156,735    |             | 150,682    |             | 75        |
| <b>Tier2 資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (7)</b>  |            |             |            |             |           |
| 一般貸倒引当金の額  | -          |             | -          |             | 76        |
| 一般貸倒引当金に係るTier2 資本算入上限額  |            |             |            |             | 77        |
| 内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。) | -          |             | -          |             | 78        |
| 適格引当金に係るTier2 資本算入上限額  |            |             |            |             | 79        |
| <b>資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)</b>   |            |             |            |             |           |
| 適格旧Tier1 資本調達手段に係る算入上限額  |            |             |            |             | 82        |
| 適格旧Tier1 資本調達手段の額から適格旧Tier1 資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)                               | -          |             | -          |             | 83        |
| 適格旧Tier2 資本調達手段に係る算入上限額  | 280,187    |             | 280,187    |             | 84        |
| 適格旧Tier2 資本調達手段の額から適格旧Tier2 資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)                               | 28,516     |             | 20,326     |             | 85        |

## 第2部 定性的な開示事項

### 1. 連結の範囲

- (1) 連結自己資本規制比率告示第2条に規定する連結自己資本規制比率を算出する対象となる会社の集団（以下、「当グループ」といいます。）に属する会社と連結財務諸表提出会社として作成された連結財務諸表における連結の範囲（以下、「会計連結範囲」といいます。）に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因

連結保険子法人等について、連結自己資本規制比率告示第3条第3項に基づき、連結自己資本規制比率算出においては非連結子会社としての取り扱いをしております。

また、連結変動持分事業体（以下、「VIE」といいます。）については、経済実態に即し、連結自己資本規制比率算出においては非連結子会社としての取り扱いを行っております。具体的には、当グループ内エンティティとの間のカウンター・パーティ・リスクは内部消去を行わずにこれを信用リスク・アセットの額として算出し、同じく当グループ内エンティティによる当該VIEの運用する資産に対する投資については、信用リスク・アセットの額又はマーケット・リスク相当額を算出しております。

- (2) 会社グループのうち、連結子会社の数並びに主要な連結子会社の名称及び主要な業務の内容

平成25年9月末において、野村証券株式会社（日本・証券業）、ノムラ・インターナショナル PLC（英国・証券業）、ノムラ・セキュリティーズ・インターナショナル Inc.（米国・証券業）、ノムラ・インターナショナル（ホンコン）LIMITED（香港・証券業）、野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービス株式会社（日本・証券業）など235社。

- (3) 連結自己資本規制比率告示第9条の規定が適用される金融業務を営む関連会社等の数並びに当該金融業務を営む関連会社等の名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

該当ありません。

- (4) 会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

当グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないものについては、該当ありません。

当グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものについては、平成25年9月末において、朝日火災海上保険株式会社（日本、保険業、総資産4,246億円、純資産461億円）、ノムラ・リインシュアランス ICC Limited（ガーンジー、保険業、総資産0.4億円、純資産0.4億円）、ノムラ・リインシュアランス 1 IC Limited（ガーンジー、保険業、総資産12億円、純資産11億円）、US CB リインシュアランス IIC Limited（ガーンジー、保険業、総資産10億円、純資産8億円）、US CB リインシュアランス 2IC Limited（ガーンジー、保険業、総資産9億円、純資産5億円）、その他VIE522社が該当

します。

(5) 当グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要

当グループの持株会社並びに子会社等に適用される法令の要件を適切に満たす自己資本の額が確保されること、また、各会社の業務の運営を損なうことなくかつ支払い能力・流動性・収益性に悪影響が及ばないこと等を十分考慮した上で適切に運営されております。

2. 連結自己資本規制比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表に関する事項

連結自己資本規制比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成した場合における連結貸借対照表（連結規制貸借対照表）の各項目の額

(単位：百万円)

|  | 連結規制貸借対照表の<br>各項目の額 |                   | 第2部の対応項目<br>(国際様式の該当項目) |
|--|---------------------|-------------------|-------------------------|
|  | 平成25年6月末            | 平成25年9月末          |                         |
| <b>資産</b>  |                     |                   |                         |
| 現金・預金  | 2,166,510           | 2,143,587         |                         |
| 貸付金および受取債権   | 2,153,178           | 2,778,268         |                         |
| 担保付契約  | 16,730,053          | 15,928,851        |                         |
| トレーディング資産およびプライベート・エクイティ投資                                 | 18,195,905          | 18,417,063        |                         |
| その他の資産   | 2,293,621           | 2,183,735         |                         |
| うち、無形固定資産であって、のれんに係るもの（のれん相当差額を含む。）の額                      | 77,593              | 75,102            | 8                       |
| うち、無形固定資産であって、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライセンスに係るもの以外のものの額          | 149,082             | 145,404           | 9                       |
| うち、モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものの額                               | -                   | -                 | 20, 24                  |
| <b>資産合計</b>  | <b>41,539,267</b>   | <b>41,451,504</b> |                         |
| <b>負債</b>  |                     |                   |                         |
| 借入金、支払債務および受入預金  | 12,058,716          | 11,277,369        |                         |
| 担保付調達  | 16,907,894          | 17,324,395        |                         |
| トレーディング負債  | 9,670,812           | 9,870,444         |                         |
| その他の負債   | 541,604             | 605,843           |                         |
| うち、無形固定資産であって、のれんに係るもの（のれん相当差額を含む。）の額に係る繰延税金負債             | -                   | -                 | 8                       |
| うち、無形固定資産であって、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライセンスに係るもの以外のものの額に係る繰延税金負債 | 11,917              | 11,624            | 9                       |
| うち、モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものの額に係る繰延税金負債                      | -                   | -                 | 20, 24                  |
| <b>負債合計</b>  | <b>39,179,026</b>   | <b>39,078,052</b> |                         |
| <b>資本</b>  |                     |                   |                         |
| 資本金及び資本剰余金の額   | 1,275,350           | 1,276,541         | 1a                      |
| 利益剰余金  | 1,178,908           | 1,195,482         | 2                       |
| 累積的その他の包括利益  | - 34,026            | - 39,189          | 3                       |
| 自己株式   | - 82,950            | - 79,651          | 1c                      |
| <b>資本合計</b>  | <b>2,337,282</b>    | <b>2,353,184</b>  |                         |

### 第3部 定量的な開示事項

#### 1. その他金融機関等であって、最終指定親会社の子法人等であるものの自己資本

その他金融機関等であって、最終指定親会社の子法人等であるもののうち、規制上の所要自己資本を下回った会社の名称と所要自己資本を下回った額の総額については、該当ありません。

#### 2. 連結自己資本規制比率に関する事項

|                               |                 | 平成25年3月末 | 平成25年9月末 | (十億円) |
|-------------------------------|-----------------|----------|----------|-------|
| 連結における普通株式等Tier1資本の額          | (A)             | 2,092.9  | 2,186.8  |       |
| 連結におけるTier1資本の額               | (B)             | 2,092.9  | 2,186.8  |       |
| 連結における総自己資本の額                 | (C)             | 2,452.1  | 2,566.6  |       |
| リスク・アセット                      | (D)=(E)+(F)+(G) | 17,546.7 | 17,854.1 |       |
| 信用リスク・アセットの額の合計額              | (E)             | 9,529.1  | 9,830.8  |       |
| マーケット・リスク相当額の合計額を8%で除して得た額    | (F)             | 5,846.1  | 5,693.3  |       |
| オペレーショナル・リスク相当額の合計額を8%で除して得た額 | (G)             | 2,171.4  | 2,329.9  |       |
| 連結普通株式等Tier1比率(%)             | (A)/(D) × 100   | 11.9%    | 12.2%    |       |
| 連結Tier1比率                     | (B)/(D) × 100   | 11.9%    | 12.2%    |       |
| 連結総自己資本規制比率(%)                | (C)/(D) × 100   | 13.9%    | 14.3%    |       |

### 3. 自己資本の充実度に関する事項

#### (1) リスク区分別所要自己資本額

|                           | 平成25年3月末 |         | 平成25年9月末 |         | (十億円) |
|---------------------------|----------|---------|----------|---------|-------|
|                           | EAD      | 所要自己資本額 | EAD      | 所要自己資本額 |       |
| 信用リスク                     | 45,163.8 | 983.0   | 44,339.9 | 986.6   |       |
| 内部格付手法                    | 27,169.5 | 694.2   | 25,993.4 | 666.1   |       |
| 金融機関等向けエクスポージャー           | 13,740.3 | 116.7   | 12,964.8 | 119.6   |       |
| ソブリン向けエクスポージャー            | 2,317.8  | 11.4    | 2,945.5  | 12.8    |       |
| 事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く) | 9,609.3  | 196.6   | 8,569.7  | 187.9   |       |
| 事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権)    | 44.6     | 7.8     | 75.8     | 9.3     |       |
| 株式等エクスポージャー               | 581.4    | 149.4   | 580.9    | 130.3   |       |
| マーケット・ベース方式の簡易手法適用分       | 330.5    | 128.0   | 316.5    | 107.9   |       |
| 経過措置適用分                   | 250.9    | 21.3    | 264.4    | 22.5    |       |
| その他                       | 758.3    | 171.2   | 745.9    | 168.8   |       |
| 信用リスク・アセットのみなし計算          | 117.8    | 41.1    | 110.7    | 37.4    |       |
| 標準的手法                     | 799.9    | 41.4    | 741.3    | 34.1    |       |
| 中央清算機関関連エクスポージャー          | 17,194.3 | 29.1    | 17,605.2 | 37.0    |       |
| CVAリスク                    | -        | 218.2   | -        | 249.3   |       |
| マーケット・リスク                 | -        | 467.7   | -        | 455.5   |       |
| 内部モデル方式および外部格付準拠方式        | -        | 467.7   | -        | 455.5   |       |
| オペレーショナル・リスク              | -        | 173.7   | -        | 186.4   |       |
| 粗利益配分手法                   | -        | 173.7   | -        | 186.4   |       |
| 連結総所要自己資本額                | -        | 1,403.7 | -        | 1,428.3 |       |

- 1 EAD: デフォルト時エクスポージャー
- 2 所要自己資本額(信用リスク): 信用リスク・アセットの額(内部格付手法対象エクスポージャーについては乗数1.06を勘案後) × 8% + 上記リスク区分にかかる調整項目(期待損失額を含む)
- 3 所要自己資本額(マーケット・リスク): マーケット・リスク相当額
- 4 所要自己資本額(オペレーショナル・リスク): オペレーショナル・リスク相当額
- 5 連結総所要自己資本額: (信用リスク・アセットの額 + マーケット・リスク相当額 ÷ 8% + オペレーショナル・リスク相当額 ÷ 8%) × 8%
- 6 エクスポージャー分類は、連結自己資本規制比率告示の規定に従っております。また、算出手法は、当グループの選択した手法に基づき開示しております。
- 7 マーケット・ベース方式の簡易手法適用分とは、上場株式等についてはリスク・ウェイト300%、非上場株式等については同400%を適用するエクスポージャーを指します。ただし、金融機関等向け出資で資本控除されず、リスクアセット計算対象となったものについては、リスク・ウェイト250%が適用されております。
- 8 経過措置適用分とは、平成16年9月30日以前より継続的に保有する株式等エクスポージャーとして算出するエクスポージャーを指します。
- 9 その他には、未決済取引、現金及びその他資産を含みます。
- 10 信用リスク・アセットのみなし計算とは、連結自己資本規制比率告示に基づき、投資信託、ファンド等に適用される手法を指します。
- 11 標準的手法とは、内部格付を適用しない事業単位及び資産区分を指します。
- 12 内部モデル方式とは、内部モデルによりマーケット・リスク相当額を算出する手法を指します。
- 13 外部格付準拠方式とは、証券化エクスポージャーに外部格付を用いてマーケット・リスク相当額を算出する手法を指します。
- 14 粗利益配分手法とは、金融費用控除後利益を業務区分に配分した上で、区分ごとに異なる乗数を適用することにより、オペレーショナル・リスク相当額を算出する手法を指します。

- (2) 証券化エクスポージャーについては、全てトレーディング業務に係るエクスポージャーとして取り扱っております。
- (3) マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャーのうち、内部モデル手法が適用される株式等エクスポージャーについては該当ありません。
- (4) PD/LGD 方式が適用される株式等エクスポージャーについては該当ありません。
- (5) マーケット・リスクに対する所要自己資本の額のうち、当グループが標準的方式を使用する対象は該当ありません。
- (6) オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額のうち、当グループが基礎的手法及び先進的計測手法を使用する対象は該当ありません。

#### 4. 信用リスク(信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー及び証券化エクスポージャーを除く。)に関する事項

##### (1) 信用リスクに関するエクスポージャー

###### 地域別内訳

|          | 平成25年3月末 |          |         | 平成25年9月末 |          |         | (十億円) |
|----------|----------|----------|---------|----------|----------|---------|-------|
|          | デリバティブ   | レボ形式の取引  | その他     | デリバティブ   | レボ形式の取引  | その他     |       |
| 国内       | 944.0    | 811.4    | 1,885.5 | 970.9    | 765.4    | 2,273.4 |       |
| 海外       | 2,710.8  | 19,074.5 | 1,625.7 | 2,973.8  | 17,296.1 | 1,603.0 |       |
| 欧州       | 1,829.7  | 1,898.3  | 909.6   | 2,281.6  | 2,489.0  | 928.3   |       |
| 北米       | 471.9    | 16,362.7 | 553.2   | 367.8    | 14,036.9 | 515.6   |       |
| アジア      | 409.1    | 813.5    | 162.8   | 324.4    | 770.2    | 159.2   |       |
| 合計       | 3,654.7  | 19,885.8 | 3,511.2 | 3,944.7  | 18,061.6 | 3,876.4 |       |
| 標準的手法適用分 |          |          | 799.9   |          |          | 741.3   |       |

###### 業種別内訳

|             | 平成25年3月末 |          |         | 平成25年9月末 |          |         | (十億円) |
|-------------|----------|----------|---------|----------|----------|---------|-------|
|             | デリバティブ   | レボ形式の取引  | その他     | デリバティブ   | レボ形式の取引  | その他     |       |
| 銀行          | 1,766.6  | 5,332.1  | 1,564.0 | 1,820.4  | 5,253.2  | 1,378.5 |       |
| ブローカー/ディーラー | 269.3    | 4,030.4  | 70.8    | 424.1    | 3,000.7  | 93.3    |       |
| その他金融・保険    | 1,041.6  | 8,055.9  | 304.8   | 1,069.0  | 7,039.8  | 309.3   |       |
| 国・地方公共団体等   | 313.1    | 2,305.7  | 215.8   | 344.6    | 2,677.1  | 760.8   |       |
| 消費関連産業      | 50.1     | 0.3      | 35.6    | 56.5     | 5.6      | 42.5    |       |
| その他         | 214.0    | 161.4    | 1,320.2 | 230.3    | 85.1     | 1,292.1 |       |
| 合計          | 3,654.7  | 19,885.8 | 3,511.2 | 3,944.7  | 18,061.6 | 3,876.4 |       |
| 標準的手法適用分    |          |          | 799.9   |          |          | 741.3   |       |

###### 残存期間別内訳

|            | 平成25年3月末 |          |         | 平成25年9月末 |          |         | (十億円) |
|------------|----------|----------|---------|----------|----------|---------|-------|
|            | デリバティブ   | レボ形式の取引  | その他     | デリバティブ   | レボ形式の取引  | その他     |       |
| 1年未満       | 256.2    | 19,203.9 | 223.8   | 460.4    | 17,424.2 | 318.6   |       |
| 1年以上3年未満   | 261.0    | 70.7     | 1,313.9 | 260.4    | 151.9    | 1,643.8 |       |
| 3年以上5年未満   | 99.5     | 106.5    | 23.0    | 121.3    | 122.8    | 16.1    |       |
| 5年以上       | 3,037.3  | 418.2    | 32.3    | 3,102.7  | 331.7    | 30.4    |       |
| 期間の定めのないもの | 0.7      | 86.5     | 1,918.2 | 0.0      | 31.1     | 1,867.5 |       |
| 合計         | 3,654.7  | 19,885.8 | 3,511.2 | 3,944.7  | 18,061.6 | 3,876.4 |       |
| 標準的手法適用分   |          |          | 799.9   |          |          | 741.3   |       |

- 1 エクスポージャーの額については、信用リスク削減効果が内部モデルに織り込まれる期待エクスポージャー方式を採用しているため、当該方式の適用対象に関しては信用リスク削減効果勘案後となっております。
- 2 地域および業種は、当グループの内部管理上の区分を用いております。
- 3 消費関連産業とは、商業、レジャー産業、小売業、飲食業、航空会社、流通、ヘルスケア、自動車、住宅関連等を指します。
- 4 期間の定めのないものには、算出上の上限を使用したものを含まみます。

##### (2) 一般貸倒引当金、個別貸倒引当金及び特定海外債権引当勘定の期末残高及び期中の増減額、及び業種別又は取引相手の別の貸出金償却の額

一般貸倒引当金、個別貸倒引当金については、連結自己資本規制比率告示において、自己資本額として取り扱われることが認められていますが、当該引当金の金額的重要性を勘案し、規制上の自己資本額として算入しておりません。

##### (3) 標準的手法が適用されるエクスポージャーについて、リスク・ウェイトの区分ごとの信用リスク削減手法の効果を勘案した後の残高(格付が付与されている信用供与の割合が信用供与の額全体の1%未満である場合には、区分を要しない。)並びに連結自己資本規制比率告示第55条第2項第2号、第101条、第155条第2項第2号及び第225条(連結自己資本規制比率告示第103条及び第112条第1項において準用する場

合に限る。)の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用されるエクスポージャーの額

|          | 平成25年3月末                              | 平成25年9月末                              | (十億円) |
|----------|---------------------------------------|---------------------------------------|-------|
|          | 信用リスク削減手法の<br>効果を勘案した後の<br>エクスポージャーの額 | 信用リスク削減手法の<br>効果を勘案した後の<br>エクスポージャーの額 |       |
| リスク・ウェイト |                                       |                                       |       |
| 0%       | 40.5                                  | 31.9                                  |       |
| 10%      | -                                     | 0.0                                   |       |
| 20%      | 35.2                                  | 39.4                                  |       |
| 35%      | 0.0                                   | 0.0                                   |       |
| 50%      | 119.1                                 | 16.3                                  |       |
| 100%     | 363.1                                 | 313.3                                 |       |
| 150%     | 3.0                                   | 1.1                                   |       |
| 350%     | 8.5                                   | 12.8                                  |       |
| 625%     | -                                     | -                                     |       |
| 937.5%   | -                                     | -                                     |       |
| 1,250%   | -                                     | -                                     |       |
| 合計       | 569.4                                 | 414.9                                 |       |

- (4) 内部格付手法が適用されるエクスポージャーのうち、スロットティング・クライテリアに割り当てられた特定貸付債権及びマーケット・ベース方式の簡易手法が適用される株式等エクスポージャーについて、連結自己資本規制比率告示第129条第3項及び第5項並びに第143条第4項に定めるリスク・ウェイトが適用される場合におけるリスク・ウェイトの区分ごとの残高

- 1) スロットティング・クライテリアに割り当てられた特定貸付債権のリスク・ウェイト区分ごとの残高

|          | 平成25年3月末 | 平成25年9月末 | (十億円) |
|----------|----------|----------|-------|
| リスク・ウェイト |          |          |       |
| 50%      | 0.6      | 0.1      |       |
| 70%      | 25.1     | 55.2     |       |
| 90%      | 4.2      | 5.3      |       |
| 95%      | -        | -        |       |
| 115%     | -        | -        |       |
| 120%     | -        | -        |       |
| 140%     | -        | -        |       |
| 250%     | 7.2      | 10.9     |       |
| 0%       | 7.5      | 4.4      |       |
| 合計       | 44.6     | 75.8     |       |

- 2) マーケット・ベース方式の簡易手法が適用される株式等エクスポージャーについては、合計3,165億円のうち、リスク・ウェイト300%適用分が1,921億円、同400%適用分が1,244億円となっております。

(5) 内部格付手法が適用されるポートフォリオについて

1) 内部格付手法が適用されるエクスポージャーの状況（エクスポージャー別）

| 平成25年3月末 (十億円) |                   |                    |                          |                            |                  |                  |                  |                                 |
|----------------|-------------------|--------------------|--------------------------|----------------------------|------------------|------------------|------------------|---------------------------------|
|                | EAD加重平均<br>PD (%) | EAD加重平均<br>LGD (%) | EAD加重平均<br>ELdefault (%) | EAD加重平均<br>リスク・ウェイト<br>(%) | EAD<br>(オン・バランス) | EAD<br>(オフ・バランス) | コミットメントの未<br>引出額 | 未引出額に<br>乗ずる掛目の<br>加重平均値<br>(%) |
| 事業法人向け         | 2.13%             | 15.37%             | -                        | 19.32%                     | 278.2            | 9,331.1          | 0.4              | 75.00%                          |
| AAA～AA-        | 0.03%             | 42.98%             | -                        | 10.78%                     | 32.5             | 1,009.5          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.24%             | 15.47%             | -                        | 11.95%                     | 180.5            | 4,367.7          | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 4.71%             | 8.05%              | -                        | 29.92%                     | 65.1             | 3,949.3          | 0.4              | 75.00%                          |
| CC～D           | 100.00%           | 45.00%             | 45.00%                   | 0.00%                      | 0.2              | 4.6              | -                | -                               |
| 金融機関等向け        | 0.25%             | 14.90%             | -                        | 9.41%                      | 1,453.4          | 12,286.9         | -                | -                               |
| AAA～AA-        | 0.03%             | 7.35%              | -                        | 1.66%                      | 142.5            | 5,267.4          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.10%             | 20.56%             | -                        | 13.30%                     | 1,278.4          | 6,405.1          | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 2.85%             | 10.58%             | -                        | 28.51%                     | 32.1             | 607.5            | -                | -                               |
| CC～D           | 100.00%           | 39.62%             | 39.62%                   | 0.00%                      | 0.3              | 7.0              | -                | -                               |
| ソブリン向け         | 0.64%             | 22.61%             | -                        | 3.11%                      | 177.0            | 2,140.8          | -                | -                               |
| AAA～AA-        | 0.02%             | 23.72%             | -                        | 1.23%                      | 177.0            | 1,681.9          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.14%             | 16.16%             | -                        | 7.90%                      | 0.0              | 412.7            | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 8.15%             | 32.99%             | -                        | 47.18%                     | -                | 35.1             | -                | -                               |
| CC～D           | 100.00%           | 45.00%             | 45.00%                   | 0.00%                      | -                | 11.1             | -                | -                               |
| 合計             | 0.99%             | 15.77%             | -                        | 12.55%                     | 1,908.6          | 23,758.8         | 0.4              | 75.00%                          |
| AAA～AA-        | 0.03%             | 15.48%             | -                        | 2.70%                      | 352.0            | 7,958.7          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.15%             | 18.58%             | -                        | 12.64%                     | 1,458.9          | 11,185.5         | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 4.48%             | 8.58%              | -                        | 29.85%                     | 97.2             | 4,591.9          | 0.4              | 75.00%                          |
| CC～D           | 100.00%           | 43.31%             | 43.31%                   | 0.00%                      | 0.5              | 22.7             | -                | -                               |

| 平成25年9月末 (十億円) |                   |                    |                          |                            |                  |                  |                  |                                 |
|----------------|-------------------|--------------------|--------------------------|----------------------------|------------------|------------------|------------------|---------------------------------|
|                | EAD加重平均<br>PD (%) | EAD加重平均<br>LGD (%) | EAD加重平均<br>ELdefault (%) | EAD加重平均<br>リスク・ウェイト<br>(%) | EAD<br>(オン・バランス) | EAD<br>(オフ・バランス) | コミットメントの未<br>引出額 | 未引出額に<br>乗ずる掛目の<br>加重平均値<br>(%) |
| 事業法人向け         | 1.85%             | 16.11%             | -                        | 20.27%                     | 246.0            | 8,323.7          | 1.1              | 75.00%                          |
| AAA～AA-        | 0.03%             | 43.27%             | -                        | 8.13%                      | 43.3             | 1,128.6          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.25%             | 15.37%             | -                        | 11.55%                     | 118.6            | 3,338.1          | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 3.68%             | 8.64%              | -                        | 31.56%                     | 84.0             | 3,852.7          | 1.1              | 75.00%                          |
| CC～D           | 100.00%           | 45.00%             | 45.00%                   | 0.00%                      | 0.2              | 4.4              | -                | -                               |
| 金融機関等向け        | 0.26%             | 17.45%             | -                        | 10.19%                     | 1,339.9          | 11,624.9         | -                | -                               |
| AAA～AA-        | 0.03%             | 10.35%             | -                        | 2.15%                      | 205.9            | 5,050.4          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.12%             | 22.86%             | -                        | 13.27%                     | 1,099.0          | 5,954.8          | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 2.71%             | 16.12%             | -                        | 41.97%                     | 35.0             | 614.2            | -                | -                               |
| CC～D           | 100.00%           | 31.38%             | 31.38%                   | 0.00%                      | 0.0              | 5.6              | -                | -                               |
| ソブリン向け         | 0.61%             | 31.98%             | -                        | 3.01%                      | 719.6            | 2,225.9          | -                | -                               |
| AAA～AA-        | 0.01%             | 35.48%             | -                        | 1.31%                      | 719.6            | 1,689.2          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.11%             | 14.99%             | -                        | 7.59%                      | 0.0              | 480.8            | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 15.03%            | 23.59%             | -                        | 45.13%                     | -                | 45.6             | -                | -                               |
| CC～D           | 100.00%           | 45.00%             | 45.00%                   | 0.00%                      | -                | 10.2             | -                | -                               |
| 合計             | 0.86%             | 18.73%             | -                        | 12.85%                     | 2,305.6          | 22,174.5         | 1.1              | 75.00%                          |
| AAA～AA-        | 0.03%             | 21.56%             | -                        | 2.71%                      | 968.7            | 7,868.1          | -                | -                               |
| A+～BBB-        | 0.16%             | 20.16%             | -                        | 12.48%                     | 1,217.6          | 9,773.7          | -                | -                               |
| BB+～CCC        | 3.66%             | 9.83%              | -                        | 33.15%                     | 119.1            | 4,512.4          | 1.1              | 75.00%                          |
| CC～D           | 100.00%           | 41.26%             | 41.26%                   | 0.00%                      | 0.2              | 20.2             | -                | -                               |

2) 内部格付手法が適用されるエクスポージャーの状況（地域別）

平成25年3月末

(十億円)

|           | EAD加重平均<br>PD (%) | EAD加重平均<br>LGD (%) | EAD加重平均<br>ELdefault (%) | EAD加重平均<br>リスク・ウェイト<br>(%) | EAD<br>(オン・バランス) | EAD<br>(オフ・バランス) | コミットメントの未<br>引出額 | 未引出額に<br>乗ずる掛目の<br>加重平均値<br>(%) |
|-----------|-------------------|--------------------|--------------------------|----------------------------|------------------|------------------|------------------|---------------------------------|
| 国内        | 0.44%             | 43.36%             | -                        | 24.93%                     | 568.0            | 1,879.4          | 0.2              | 75.00%                          |
| AAA ~ AA- | 0.02%             | 44.87%             | -                        | 6.03%                      | 166.5            | 711.3            | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.15%             | 42.72%             | -                        | 32.39%                     | 387.0            | 1,111.6          | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 5.54%             | 37.72%             | -                        | 108.15%                    | 14.4             | 52.1             | 0.2              | 75.00%                          |
| CC ~ D    | 100.00%           | 45.00%             | 45.00%                   | 0.00%                      | 0.2              | 4.5              | -                | -                               |
| 欧州        | 2.16%             | 37.89%             | -                        | 38.70%                     | 714.9            | 3,820.0          | 0.2              | 75.00%                          |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 43.45%             | -                        | 9.57%                      | 120.8            | 943.3            | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.14%             | 40.79%             | -                        | 29.63%                     | 537.9            | 1,913.6          | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 7.57%             | 24.79%             | -                        | 92.61%                     | 55.9             | 944.9            | 0.2              | 75.00%                          |
| CC ~ D    | 100.00%           | 42.88%             | 42.88%                   | 0.00%                      | 0.3              | 18.2             | -                | -                               |
| 北米        | 0.76%             | 5.81%              | -                        | 3.18%                      | 484.7            | 16,836.1         | -                | -                               |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 6.28%              | -                        | 0.93%                      | 45.8             | 6,164.6          | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.16%             | 6.96%              | -                        | 3.49%                      | 422.8            | 7,191.3          | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 3.36%             | 2.47%              | -                        | 6.49%                      | 16.1             | 3,480.1          | -                | -                               |
| CC ~ D    | 100.00%           | 45.00%             | 45.00%                   | 0.00%                      | -                | 0.0              | -                | -                               |
| アジア       | 1.05%             | 19.24%             | -                        | 22.48%                     | 141.1            | 1,223.3          | -                | -                               |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 25.22%             | -                        | 7.63%                      | 18.9             | 139.5            | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.10%             | 16.66%             | -                        | 11.12%                     | 111.3            | 969.0            | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 10.50%            | 33.95%             | -                        | 138.85%                    | 10.9             | 114.8            | -                | -                               |
| CC ~ D    | -                 | -                  | -                        | -                          | -                | -                | -                | -                               |
| 合計        | 0.99%             | 15.77%             | -                        | 12.55%                     | 1,908.6          | 23,758.8         | 0.4              | 75.00%                          |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 15.48%             | -                        | 2.70%                      | 352.0            | 7,958.7          | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.15%             | 18.58%             | -                        | 12.64%                     | 1,458.9          | 11,185.5         | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 4.48%             | 8.58%              | -                        | 29.85%                     | 97.2             | 4,591.9          | 0.4              | 75.00%                          |
| CC ~ D    | 100.00%           | 43.31%             | 43.31%                   | 0.00%                      | 0.5              | 22.7             | -                | -                               |

平成25年9月末

(十億円)

|           | EAD加重平均<br>PD (%) | EAD加重平均<br>LGD (%) | EAD加重平均<br>ELdefault (%) | EAD加重平均<br>リスク・ウェイト<br>(%) | EAD<br>(オン・バランス) | EAD<br>(オフ・バランス) | コミットメントの未<br>引出額 | 未引出額に<br>乗ずる掛目の<br>加重平均値<br>(%) |
|-----------|-------------------|--------------------|--------------------------|----------------------------|------------------|------------------|------------------|---------------------------------|
| 国内        | 0.37%             | 40.48%             | -                        | 16.42%                     | 983.0            | 1,851.7          | 0.2              | 75.00%                          |
| AAA ~ AA- | 0.01%             | 42.98%             | -                        | 3.48%                      | 691.2            | 816.8            | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.14%             | 37.63%             | -                        | 26.76%                     | 280.2            | 968.3            | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 5.93%             | 37.18%             | -                        | 106.61%                    | 11.4             | 62.5             | 0.2              | 75.00%                          |
| CC ~ D    | 100.00%           | 45.00%             | 45.00%                   | 0.00%                      | 0.2              | 4.1              | -                | -                               |
| 欧州        | 1.80%             | 39.36%             | -                        | 35.08%                     | 752.2            | 4,809.1          | 0.3              | 75.00%                          |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 44.95%             | -                        | 7.60%                      | 218.9            | 1,453.6          | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.15%             | 38.92%             | -                        | 24.47%                     | 454.4            | 2,406.9          | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 7.80%             | 31.33%             | -                        | 111.12%                    | 78.9             | 932.4            | 0.3              | 75.00%                          |
| CC ~ D    | 100.00%           | 40.27%             | 40.27%                   | 0.00%                      | 0.0              | 16.1             | -                | -                               |
| 北米        | 0.58%             | 6.78%              | -                        | 3.29%                      | 431.7            | 14,418.5         | -                | -                               |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 8.59%              | -                        | 0.96%                      | 50.5             | 5,465.2          | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.16%             | 7.77%              | -                        | 4.09%                      | 356.4            | 5,539.1          | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 2.18%             | 2.20%              | -                        | 5.67%                      | 24.7             | 3,414.2          | -                | -                               |
| CC ~ D    | -                 | -                  | -                        | -                          | -                | -                | -                | -                               |
| アジア       | 1.04%             | 19.55%             | -                        | 19.57%                     | 138.7            | 1,095.2          | 0.6              | 75.00%                          |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 22.40%             | -                        | 5.20%                      | 8.0              | 132.5            | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.16%             | 17.66%             | -                        | 9.78%                      | 126.6            | 859.4            | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 10.44%            | 33.16%             | -                        | 128.31%                    | 4.0              | 103.3            | 0.6              | 75.00%                          |
| CC ~ D    | -                 | -                  | -                        | -                          | -                | -                | -                | -                               |
| 合計        | 0.86%             | 18.73%             | -                        | 12.85%                     | 2,305.6          | 22,174.5         | 1.1              | 75.00%                          |
| AAA ~ AA- | 0.03%             | 21.56%             | -                        | 2.71%                      | 968.7            | 7,868.1          | -                | -                               |
| A+ ~ BBB- | 0.16%             | 20.16%             | -                        | 12.48%                     | 1,217.6          | 9,773.7          | -                | -                               |
| BB+ ~ CCC | 3.66%             | 9.83%              | -                        | 33.15%                     | 119.1            | 4,512.4          | 1.1              | 75.00%                          |
| CC ~ D    | 100.00%           | 41.26%             | 41.26%                   | 0.00%                      | 0.2              | 20.2             | -                | -                               |

1 PDは、向こう1年間にデフォルトが発生する確率の推計値、LGDは、EADに対するデフォルトしたエクスポージャーに生じる損失額の割合を示しております。

2 エクスポージャーの額(EAD)については、信用リスク削減効果が内部モデルに織り込まれる期待エクスポージャー方式を採用しているため、当該方式の適用対象に関しては信用リスク削減効果勘案後となっております。

3 信用リスク・アセット算出上に使用した内部格付で分類しているため、一部実際のエクスポージャーに付与された内部格付に比べて保守的な区分となっております。

4 連結自己資本規制比率算出上のデフォルト区分はCC、C及びDとしております。

5 内部格付手法が適用されるエクスポージャーのうち、未決済取引、株式等エクスポージャー、スロッシング・クライテリアに割り当てられた特定貸付債権、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー、現金及びその他資産は除外しております。

6 地域は、当グループの内部管理上の区分を用いております。

3) PD/LGD 方式を適用する株式等エクスポージャーにおける債務者格付ごとの PD の推計値、リスク・ウェイトの加重平均値及び残高については該当ありません。

4) 居住用不動産向けエクスポージャー、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー及びその他リテール向けエクスポージャー 次のいずれかの事項

i) プール単位での PD の推計値、LGD の推計値（デフォルトしたエクスポージャーに係る  $EL_{\text{default}}$  を含む。）の加重平均値、リスク・ウェイトの加重平均値、オン・バランス資産項目の EAD の推計値、オフ・バランス資産項目の EAD の推計値、コミットメントの未引出額及び当該未引出額に乗ずる掛目の推計値の加重平均値

ii) 適切な数の EL 区分を設けた上でのプール単位でのエクスポージャーの分析

当グループにおいて、リスク・アセットベースにおけるリテール関連の信用リスク・アセットの額は僅少であり、算出上はリテール・プールを作成せず、事業法人等エクスポージャー又は適用除外資産として取り扱っていることから、該当ありません。

(6) 内部格付手法を適用する事業法人向けエクスポージャー、ソブリン向けエクスポージャー、金融機関等向けエクスポージャー、PD/LGD 方式を適用する株式等エクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー及びその他リテール向けエクスポージャーごとの、直前期における損失の実績値、当該実績値と過去の実績値との対比並びに要因分析、及び長期にわたる損失額の推計値と実績値の対比

当グループでは、市場性のある取引またはそれに裏付けられた取引がビジネスの中心になっており、金融資産の公正価値の把握およびその変動リスクの把握が重要となっています。内部格付手法を適用しているエクスポージャーは、デリバティブ等取引に係るカウンターパーティ向けの与信が大半であり、これらの与信に係る損失は公正価値の見直し（評価損益）、又はポジション解消（売却損益）を通じて実現されるケースも多数存在します。当該損失は、信用リスクに起因する部分と市場リスクに起因する部分が混在し、両者を判別することが困難であることから、信用リスクに起因する損失実績値の集計は行っておりません。

また当グループにおいて、内部格付手法の適用対象となるエクスポージャーについては、過去長期間にわたり、実際に発生したデフォルト件数が少ない中、PD 推計値は、過去長期間の実績値との対比では相当保守的な水準になっております。

## 5. 信用リスク削減手法に関する事項

内部格付手法において信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャー

|                 | 平成25年3月末 |      |    |              | (十億円) |
|-----------------|----------|------|----|--------------|-------|
|                 | 金融資産担保   | 資産担保 | 保証 | クレジット・デリバティブ |       |
| 内部格付手法          | 16,675.5 | -    | -  | -            | -     |
| 金融機関等向けエクスポージャー | 9,194.3  | -    | -  | -            | -     |
| ソブリン向けエクスポージャー  | 1,153.0  | -    | -  | -            | -     |
| 事業法人向けエクスポージャー  | 6,328.2  | -    | -  | -            | -     |

  

|                 | 平成25年9月末 |      |    |              | (十億円) |
|-----------------|----------|------|----|--------------|-------|
|                 | 金融資産担保   | 資産担保 | 保証 | クレジット・デリバティブ |       |
| 内部格付手法          | 14,296.2 | -    | -  | -            | -     |
| 金融機関等向けエクスポージャー | 7,941.8  | -    | -  | -            | -     |
| ソブリン向けエクスポージャー  | 851.9    | -    | -  | -            | -     |
| 事業法人向けエクスポージャー  | 5,502.5  | -    | -  | -            | -     |

- 1 金融資産担保とは、現金や有価証券等のうち、連結自己資本規制比率告示にて適格なものとして定められたものを指します。
- 2 信用リスク削減効果が内部モデルに織り込まれる期待エクスポージャー方式を採用しているため、金融資産担保の額は、期待エクスポージャー方式が適用されなかったエクスポージャーに対して充当された額を示しております。

## 6. 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する事項

(1) 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクの状況

|                              |                 | 平成25年3月末   |          |              | (十億円) |
|------------------------------|-----------------|------------|----------|--------------|-------|
|                              |                 | グロスの再構築コスト | グロスのアドオン | 与信相当額(担保勘案前) |       |
| 派生商品取引                       | (A)             | 1,116.4    | 743.1    | 1,859.5      |       |
| 外国為替関連取引および金関連取引             |                 | 186.2      | 159.8    | 346.0        |       |
| 金利関連取引                       |                 | 599.6      | 41.7     | 641.3        |       |
| 株式関連取引                       |                 | 83.7       | 172.9    | 256.6        |       |
| 貴金属関連取引(金を除く)                |                 | -          | -        | -            |       |
| その他のコモディティ関連取引               |                 | 1.2        | 2.4      | 3.6          |       |
| クレジット・デリバティブ取引               |                 | 245.7      | 366.3    | 612.0        |       |
| 長期決済期間取引                     | (B)             | 121.3      | 0.0      | 121.3        |       |
| 一括清算ネットティング契約による与信相当額削減効果( ) | (C)             | -          | -        | 925.4        |       |
| ネットの与信相当額                    | (D)=(A)+(B)-(C) | -          | -        | 1,055.4      |       |
| 担保の額                         | (E)             | -          | -        | 306.3        |       |
| 金融資産担保                       |                 | -          | -        | 306.3        |       |
| 与信相当額(担保勘案後)                 | (D)-(E)         | -          | -        | 749.1        |       |

  

|                              |                 | 平成25年9月末   |          |              | (十億円) |
|------------------------------|-----------------|------------|----------|--------------|-------|
|                              |                 | グロスの再構築コスト | グロスのアドオン | 与信相当額(担保勘案前) |       |
| 派生商品取引                       | (A)             | 1,896.7    | 1,482.9  | 3,379.6      |       |
| 外国為替関連取引および金関連取引             |                 | 156.7      | 151.2    | 308.0        |       |
| 金利関連取引                       |                 | 636.9      | 46.2     | 683.1        |       |
| 株式関連取引                       |                 | 839.9      | 933.5    | 1,773.4      |       |
| 貴金属関連取引(金を除く)                |                 | 0.0        | 1.0      | 1.0          |       |
| その他のコモディティ関連取引               |                 | 2.0        | 100.0    | 102.0        |       |
| クレジット・デリバティブ取引               |                 | 261.1      | 251.0    | 512.2        |       |
| 長期決済期間取引                     | (B)             | 3.3        | 0.0      | 3.3          |       |
| 一括清算ネットティング契約による与信相当額削減効果( ) | (C)             | -          | -        | 2,012.1      |       |
| ネットの与信相当額                    | (D)=(A)+(B)-(C) | -          | -        | 1,370.8      |       |
| 担保の額                         | (E)             | -          | -        | 339.6        |       |
| 金融資産担保                       |                 | -          | -        | 339.6        |       |
| 与信相当額(担保勘案後)                 | (D)-(E)         | 0.0        | 0.0      | 1,031.2      |       |

- 1 カレント・エクスポージャー方式を用いて与信相当額を算出している部分につき集計しております。

- (2) 与信相当額算出の対象となるクレジット・デリバティブの想定元本額をクレジット・デリバティブの種類別、かつ、プロテクションの購入又は提供の別に区分した額

|                           | 平成25年3月末 |          | 平成25年9月末 |          |
|---------------------------|----------|----------|----------|----------|
|                           | 提供       | 購入       | 提供       | 購入       |
| クレジット・デフォルト・スワップ(個別)      | 24,657.9 | 24,173.3 | 24,854.4 | 25,024.1 |
| クレジット・デフォルト・スワップ(指数)      | 12,722.3 | 13,309.4 | 11,305.2 | 11,805.8 |
| その他のクレジット・リスク関連ポートフォリオ商品  | 2,586.2  | 3,380.4  | 1,802.5  | 2,210.1  |
| クレジット・リスク関連オプションおよびスワプション | 51.2     | 33.5     | 598.3    | 300.2    |
| 合計                        | 40,017.7 | 40,896.6 | 38,560.4 | 39,340.2 |

## 7. 会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャーに関する事項

証券化エクスポージャーについては、全てトレーディング業務に係るエクスポージャーとして取り扱っております。

- (1) 保有する証券化エクスポージャー（包括的リスクの計測対象は除く）の額及び主な原資産の種類別の内訳

|            | 平成25年3月末   |                  |                      | 平成25年9月末   |                  |                      |
|------------|------------|------------------|----------------------|------------|------------------|----------------------|
|            | エクスポージャーの額 | (うち再証券化エクスポージャー) | (うち100%のリスク・ウェイト適用分) | エクスポージャーの額 | (うち再証券化エクスポージャー) | (うち100%のリスク・ウェイト適用分) |
| RMBS       | 143.8      | 3.6              | 105.1                | 192.9      | 5.0              | 118.0                |
| CMBS       | 135.1      | 7.3              | 36.9                 | 144.0      | 0.0              | 44.4                 |
| CDO/CLO    | 20.6       | 0.6              | 8.9                  | 33.3       | 0.0              | 11.6                 |
| Consumer   | 41.5       | -                | 0.8                  | 38.4       | -                | 0.7                  |
| Commercial | 4.4        | -                | 1.2                  | 7.2        | -                | 0.6                  |
| その他        | 26.0       | -                | 5.4                  | 38.1       | 0.0              | 7.7                  |
| 合計         | 371.3      | 11.4             | 158.3                | 453.8      | 5.0              | 183.0                |

- (2) 保有する証券化エクスポージャー（包括的リスクの計測対象は除く）の適切な数のリスク・ウェイトの区分ごとの残高及び所要自己資本の額

|             | 平成25年3末    |                  |          |                  | 平成25年9末    |                  |          |                  |
|-------------|------------|------------------|----------|------------------|------------|------------------|----------|------------------|
|             | エクスポージャーの額 | (うち再証券化エクスポージャー) | 所要自己資本の額 | (うち再証券化エクスポージャー) | エクスポージャーの額 | (うち再証券化エクスポージャー) | 所要自己資本の額 | (うち再証券化エクスポージャー) |
| 1.6%以下      | 80.4       | -                | 0.5      | -                | 99.1       | -                | 0.6      | -                |
| 1.6%超 4%以下  | 67.9       | 0.1              | 1.4      | 0.0              | 92.3       | 0.0              | 1.8      | 0.0              |
| 4%超 8%以下    | 23.0       | 1.0              | 1.2      | 0.1              | 40.0       | -                | 2.1      | -                |
| 8%超 20%以下   | 8.5        | -                | 0.7      | -                | 16.8       | -                | 2.3      | -                |
| 20%超 100%未満 | 33.1       | -                | 12.5     | -                | 22.7       | -                | 10.9     | -                |
| 100%        | 158.3      | 10.3             | 158.3    | 10.3             | 183.0      | 5.0              | 183.0    | 5.0              |
| 合計          | 371.3      | 11.4             | 174.5    | 10.4             | 453.8      | 5.0              | 200.7    | 5.0              |

1. リスク・ウェイトの区分は、マーケット・リスクの個別リスクにおいて使用される表記を用いております。

- (3) 保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに適切なリスクの種類別の包括的リスクの期末値の内訳及びその総額

|             | 平成25年3月末 | 平成25年9月末 | (十億円) |
|-------------|----------|----------|-------|
| エクスポージャーの総額 |          |          |       |
| ヘッジ込み       | 1,096.1  | 1,031.1  |       |
| ヘッジ除外       | 957.5    | 705.4    |       |
| 所要自己資本      |          |          |       |
| デフォルト       | 11.2     | 2.2      |       |
| 相関          | -1.0     | -0.6     |       |
| クレジットスプレッド  | 1.2      | 0.4      |       |
| その他         | 12.3     | 5.6      |       |
| 包括的リスクの額    | 23.6     | 7.6      |       |

## 8. マーケット・リスクに関する事項

(1) 期末の VaR の値並びに開示期間における VaR の最高、平均及び最低の値

|            | 平成24年4月1日から平成25年3月31日まで |      |      |          | 平成25年4月1日から平成25年9月30日まで |      |      |          | (十億円) |
|------------|-------------------------|------|------|----------|-------------------------|------|------|----------|-------|
|            | 日次平均                    | 最高   | 最低   | 平成25年3月末 | 日次平均                    | 最高   | 最低   | 平成25年9月末 |       |
| VaR(10day) | 20.6                    | 30.3 | 14.2 | 15.2     | 16.5                    | 23.9 | 11.8 | 11.9     |       |

VaR(10day)の前提

信頼水準：片側検定99%

保有期間：10日

商品間の価格変動の相関を考慮

(2) 期末のストレス VaR の値並びに開示期間におけるストレス VaR の最高、平均及び最低の値

|         | 平成24年4月1日から平成25年3月31日まで |      |      |          | 平成25年4月1日から平成25年9月30日まで |      |      |          | (十億円) |
|---------|-------------------------|------|------|----------|-------------------------|------|------|----------|-------|
|         | 日次平均                    | 最高   | 最低   | 平成25年3月末 | 日次平均                    | 最高   | 最低   | 平成25年9月末 |       |
| ストレスVaR | 37.2                    | 72.8 | 21.6 | 29.1     | 34.8                    | 51.9 | 17.2 | 17.8     |       |

ストレス VaR の前提

信頼水準：片側検定99%

保有期間：10日

商品間の価格変動の相関を考慮

(3) 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における所要自己資本の最高、平均及び最低の額

|        | 平成24年4月1日から平成25年3月31日まで |       |      |          | 平成25年4月1日から平成25年9月30日まで |       |      |          | (十億円) |
|--------|-------------------------|-------|------|----------|-------------------------|-------|------|----------|-------|
|        | 日次平均                    | 最高    | 最低   | 平成25年3月末 | 日次平均                    | 最高    | 最低   | 平成25年9月末 |       |
| 追加的リスク | 95.1                    | 125.7 | 77.7 | 108.4    | 110.6                   | 139.8 | 89.6 | 108.6    |       |
| 包括的リスク | 18.9                    | 27.0  | 14.3 | 23.9     | 20.2                    | 28.1  | 16.8 | 17.3     |       |

(4) バック・テストの結果及び損益の実績値が VaR の値から大幅に下方乖離した場合についての説明

平成 25 年 4 月 1 日から平成 25 年 9 月 30 日までの期間において、バックテスト超過は 1 回ありました。

## 9. トレーディング業務以外の出資等又は株式等エクスポージャーに関する事項

### (1) 連結貸借対照表計上額

|                  | 平成25年3月末       |       | 平成25年9月末       |       | (十億円) |
|------------------|----------------|-------|----------------|-------|-------|
|                  | 連結貸借対照表<br>計上額 | 時価    | 連結貸借対照表<br>計上額 | 時価    |       |
| 経過措置適用分          | 250.9          | 250.9 | 264.4          | 264.4 |       |
| 上場株式等エクスポージャー    | 178.9          | 178.9 | 192.1          | 192.1 |       |
| 上記以外の株式等エクスポージャー | 151.6          | 151.6 | 124.4          | 124.4 |       |
| 合計               | 581.4          | 581.4 | 580.9          | 580.9 |       |

### (2) 補完的項目に算入されたその他有価証券の評価益の45%相当額

|                               | 平成25年3月末 | 平成25年9月末 | (十億円) |
|-------------------------------|----------|----------|-------|
| 補完的項目に算入されたその他有価証券の評価益の45%相当額 | -        | -        |       |

### (3) 株式等エクスポージャーのポートフォリオ区分ごとの額

|                        | 平成25年3月末 | 平成25年9月末 | (十億円) |
|------------------------|----------|----------|-------|
| PD/LGD方式               | -        | -        |       |
| マーケット・ベース方式の簡易手法適用分    | 330.5    | 316.5    |       |
| マーケット・ベース方式の内部モデル手法適用分 | -        | -        |       |
| 経過措置適用分                | 250.9    | 264.4    |       |
| 合計                     | 581.4    | 580.9    |       |

尚、連結貸借対照表で認識され、かつ、連結損益計算書で認識されない評価損益の額及び連結貸借対照表及び連結損益計算書で認識されない評価損益の額については該当ありません。

## 10. トレーディング業務以外の取引から生じる金利リスクに関して会社グループが内部管理上使用した金利ショックに対する損益又は経済的価値の増減に関する事項

当グループは、トレーディング業務を主たる業務としており、金利リスクは市場リスク管理の枠組みで管理しています。また、当グループは、預金預入業務を主たる業務とはしておらず、トレーディング業務以外の取引から生じる金利リスクの損益、経済的価値に対する影響は極めて限定的であると認識しています。

## 第4部 自己資本調達手段に関する契約内容

### 1. 野村ホールディングス株式会社 普通株式

自己資本調達手段（普通株式）

|    |   |                        |
|----|---|------------------------|
| 1  | 発行者   | 野村ホールディングス株式会社         |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号   | JP3762600009           |
| 3  | 準拠法   | 日本法                    |
|    | 規制上の取扱い（1）  |                        |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | 普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額 |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | 普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額 |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者（2）  |                        |
| 7  | 銘柄、名称又は種類   | 普通株式                   |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額（3）<br>連結自己資本規制比率   | 594,493百万円             |
| 9  | 額面総額（4）   |                        |
| 10 | 表示される科目の区分（5）<br>連結貸借対照表  | 株主資本<br>株主資本           |
| 11 | 発行日（6）  |                        |
| 12 | 償還期限の有無   | 無                      |
| 13 | その日付  |                        |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無  | 無                      |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額（7）<br>特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額（8）                                 |                        |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要（9）   |                        |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払   |                        |
| 17 | 配当率又は利率の種別（10）  |                        |
| 18 | 配当率又は利率（11）   |                        |
| 19 | 配当等停止条項の有無（12）  |                        |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無（13）  |                        |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無  |                        |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無  |                        |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無   | 無                      |
| 24 | 転換が生じる場合（14）  |                        |
| 25 | 転換の範囲（15）   |                        |
| 26 | 転換の比率（16）   |                        |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無（17）  |                        |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類  |                        |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者   |                        |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無（18）   | 無                      |
| 31 | 元本の削減が生じる場合（19）   |                        |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲（20）   |                        |
| 33 | 元本回復特約の有無（21）   |                        |
| 34 | その概要  |                        |
| 35 | 剰余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類（22） | 劣後債務                   |
| 36 | 非充足資本要件の有無（23）  | 無                      |
| 37 | 非充足資本要件の内容（23）  |                        |

## 2. 野村ホールディングス株式会社 第1回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約及び条件付債務免除特約付)

自己資本調達手段(劣後債)

|    |  |   |
|----|--|---|
| 1  | 発行者  | 野村ホールディングス株式会社  |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号                      | JP376260ABC4  |
| 3  | 準拠法  | 日本法   |
|    | 規制上の取扱い(1)                                 |   |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い | Tier2 資本に係る基礎項目の額   |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い    | Tier2 資本に係る基礎項目の額   |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(2)             |   |
| 7  | 銘柄、名称又は種類                                  | 野村ホールディングス株式会社第1回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約及び条件付債務免除特約付)  |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(3)                    |   |
|    | 連結自己資本規制比率                                 | 153,990百万円  |
| 9  | 額面総額(4)                                    | 154,300百万円  |
| 10 | 表示される科目の区分(5)                              | 負債  |
|    | 連結貸借対照表                                    | 負債  |
| 11 | 発行日(6)                                     | 平成23年12月26日   |
| 12 | 償還期限の有無                                    | 有   |
| 13 | その日付                                       | 平成33年12月24日   |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無                             | 有   |
|    | 初回償還可能日及びその償還金額(7)                         | 初回償還可能日:平成28年12月26日<br>償還金額:各社債の金額100円につき100円   |
| 15 | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(8)                | 特別早期償還特約の対象となる事由:<br>発行者が金融庁その他の監督当局と協議した結果、本社債がパーゼルIII基準に準拠して金融庁その他の監督当局が定める発行者に適用ある自己資本規制比率算入基準に照らして、発行者のTier2資本として扱われなくなるおそれが軽微でないと判断した場合(発行者のTier2資本の算入制限超過を理由として発行者のTier2資本として扱われなくなる場合を除く。)<br>償還金額:各社債の金額100円につき100円 |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(9)            |   |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払                              |   |
| 17 | 配当率又は利率の種別(10)                             | 固定から変動  |
| 18 | 配当率又は利率(11)                                | 平成23年12月27日から平成28年12月26日まで:<br>年2.24パーセント<br>平成28年12月26日の翌日以降:<br>5年物円スワップのオフアード・レートに1.70パーセントを加算し、小数点以下第3位を切り上げたもの。  |
| 19 | 配当等停止条項の有無(12)                             | 無   |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(13)           | 裁量なし  |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無     | 無   |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無                     | 無   |

|    |  |   |
|----|--|---|
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無  | 無   |
| 24 | 転換が生じる場合 (14)  |   |
| 25 | 転換の範囲 (15)   |   |
| 26 | 転換の比率 (16)   |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無 (17)  |   |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類   |   |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者  |   |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無 (18)   | 有   |
| 31 | 元本の削減が生じる場合 (19)   | ①または②の事由が生じた場合：<br>①本社債及び発行者のTier2資本として扱われる発行者の他の債務（本元本の削減に係る特約と同等の特約が付されたものに限る。）にかかる債務減免がなければ、発行者が存続不可能になると金融庁その他の監督当局が決定した場合<br>②公的機関またはこれに類似する組織による資本注入またはこれに準ずる行為がなければ発行者が存続不可能になると金融庁その他の監督当局が決定した場合 |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲 (20)   | 常に全部削減  |
| 33 | 元本回復特約の有無 (21)   | 無   |
| 34 | その概要   |   |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (22) | 一般債務  |
| 36 | 非充足資本要件の有無 (23)  | 無   |
| 37 | 非充足資本要件の内容 (23)  |   |

#### ■その他の契約内容

##### 担保

本社債には担保及び保証は付されておらず、また本社債のために特に留保されている資産はない。

##### 財務上の特約

担保提供制限条項その他の条項は付されていない。

##### 期限の利益喪失に関する特約

- (1) 本社債は期限の利益喪失に関する特約を付さない。
- (2) 本社債の社債権者は、会社法第739条に定める決議を行う権利を有さず、本社債が同条に基づき期限の利益を喪失せしめられることはない。

##### 劣後特約

- (1) 次の各場合には、本社債の償還及び利息の支払いは以下の規定に従って行われる。

###### ①破産の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について破産手続開始の決定がなされ、かつ破産手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

その破産手続の最後の配当のための配当表（更正された場合は、更正後のもの）に記載された配当に加えるべき債権のうち、本社債に基づく債権及び本劣後特約（1）①ないし④と実質的に同一またはこれに劣後する条件を付された債権（ただし、本劣後特約（1）③を除き本劣後特約（1）と実質的に同一の条件を付された債権は、本劣後特約（1）①ないし④と実質的に同一の条件を付された債権とみなす。）（かかる条件を付された債権を、本社債に基づく債権とともに、以下「劣後債権」という。）を除く全ての債権が、各中間配当、最後の配当及び追加配当によって、その債権額につき全額の満足（配当及び供託を含む。）を受けたこと。

###### ②会社更生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について会社更生手続開始の決定がなされ、かつ更生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、会社更生計画認可の決定が確定したときにおける更正計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

### ③民事再生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について民事再生手続開始の決定がなされ、かつ簡易再生または同意再生の決定がなされることなく再生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、民事再生計画認可の決定が確定したときにおける再生計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

### ④日本法によらない破産、会社更生及び民事再生の場合

当社について、日本法によらない破産手続、会社更生手続、民事再生手続またはこれに準ずる手続が外国において本劣後特約（１）①ないし③に準じて行われる場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、その手続において本劣後特約（１）①ないし③の停止条件に準ずる条件が成就したときに、その手続上発生するものとする。ただし、その手続上そのような条件を付すことが認められない場合には、当該条件にかかることなく発生するものとする。

（２）本社債の社債要項の各条項は、いかなる意味においても、劣後債権の債権者以外の当社の債権者に対して不利益を及ぼす内容にこれを変更してはならず、かかる変更の合意はいかなる意味においても、またいかなる者に対しても効力を生じない。

（３）本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（１）①ないし④に従って停止しているにもかかわらず、当該元利金の全部または一部が社債権者に支払われた場合には、その支払いは無効とし、社債権者はその受領した元利金をただちに当社に返還する。

（４）本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（１）①ないし④に従って停止している間は、本社債に基づく元利金の支払請求権を相殺の対象とすることはできない。

（５）本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（１）①ないし④に従って停止したために当該元利金の支払いが本社債の社債要項に定めた期日に遅れた場合には、社債権者は当該遅滞に関して利息その他の支払いを請求することが出来ない。

（６）当社について破産手続が開始された場合、当該破産手続における本社債に基づく元利金の支払請求権の配当の順位は、破産法に規定する劣後的破産債権に後れるものとする。

### 3. 野村ホールディングス株式会社 第2回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約及び条件付債務免除特約付)

自己資本調達手段 (劣後債)

|    |  |  |
|----|--|--|
| 1  | 発行者  | 野村ホールディングス株式会社   |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号                      | JP376260BBC2   |
| 3  | 準拠法  | 日本法  |
|    | 規制上の取扱い (1)                                |  |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い | Tier2 資本に係る基礎項目の額  |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い    | Tier2 資本に係る基礎項目の額  |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (2)            |  |
| 7  | 銘柄、名称又は種類                                  | 野村ホールディングス株式会社第2回期限前償還条項付無担保社債 (劣後特約及び条件付債務免除特約付)  |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (3)                   |  |
|    | 連結自己資本規制比率                                 | 15,700百万円  |
| 9  | 額面総額 (4)                                   | 15,700百万円  |
| 10 | 表示される科目の区分 (5)                             | 負債   |
|    | 連結貸借対照表                                    | 負債   |
| 11 | 発行日 (6)                                    | 平成23年12月26日  |
| 12 | 償還期限の有無                                    | 有  |
| 13 | その日付                                       | 平成33年12月24日  |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無                             | 有  |
|    | 初回償還可能日及びその償還金額 (7)                        | 初回償還可能日:平成28年12月26日<br>償還金額:各社債の金額100円につき100円  |
| 15 | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (8)               | 特別早期償還特約の対象となる事由:<br>発行者が金融庁その他の監督当局と協議した結果、本社債がバーゼルIII基準に準拠して金融庁その他の監督当局が定める発行者に適用ある自己資本規制比率算入基準に照らして、発行者のTier2資本として扱われなくなるおそれが軽微でないと判断した場合 (発行者のTier2資本の算入制限超過を理由として発行者のTier2資本として扱われなくなる場合を除く。)<br>償還金額:各社債の金額100円につき100円 |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (9)           |  |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払                              |  |
| 17 | 配当率又は利率の種別 (10)                            | 固定から変動   |
| 18 | 配当率又は利率 (11)                               | 平成23年12月27日から平成28年12月26日まで:<br>年2.24パーセント<br>平成28年12月26日の翌日以降:<br>5年物円スワップのオファード・レートに1.70パーセントを加算し、小数点以下第3位を切り上げたもの。   |
| 19 | 配当等停止条項の有無 (12)                            | 無  |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (13)          | 裁量なし   |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無     | 無  |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無                     | 無  |

|    |  |   |
|----|--|---|
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無  | 無   |
| 24 | 転換が生じる場合 (14)  |   |
| 25 | 転換の範囲 (15)   |   |
| 26 | 転換の比率 (16)   |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無 (17)  |   |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類   |   |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者  |   |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無 (18)   | 有   |
| 31 | 元本の削減が生じる場合 (19)   | ①または②の事由が生じた場合:<br>①本社債及び発行者のTier2資本として扱われる発行者の他の債務（本元本の削減に係る特約と同等の特約が付されたものに限る。）にかかる債務減免がなければ、発行者が存続不可能になると金融庁その他の監督当局が決定した場合<br>②公的機関またはこれに類似する組織による資本注入またはこれに準ずる行為がなければ発行者が存続不可能になると金融庁その他の監督当局が決定した場合 |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲 (20)   | 常に全部削減  |
| 33 | 元本回復特約の有無 (21)   | 無   |
| 34 | その概要   |   |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (22) | 一般債務  |
| 36 | 非充足資本要件の有無 (23)  | 無   |
| 37 | 非充足資本要件の内容 (23)  |   |

■その他の契約内容

**担保**

本社債には担保及び保証は付されておらず、また本社債のために特に留保されている資産はない。

**財務上の特約**

担保提供制限条項その他の条項は付されていない。

**期限の利益喪失に関する特約**

- (1) 本社債は期限の利益喪失に関する特約を付さない。
- (2) 本社債の社債権者は、会社法第739条に定める決議を行う権利を有さず、本社債が同条に基づき期限の利益を喪失せしめられることはない。

**劣後特約**

- (1) 次の各場合には、本社債の償還及び利息の支払いは以下の規定に従って行われる。

①破産の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について破産手続開始の決定がなされ、かつ破産手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

その破産手続の最後の配当のための配当表（更正された場合は、更正後のもの）に記載された配当に加えるべき債権のうち、劣後債権を除く全ての債権が、各中間配当、最後の配当及び追加配当によって、その債権額につき全額の満足（配当及び供託を含む。）を受けたこと。

②会社更生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について会社更生手続開始の決定がなされ、かつ更生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、会社更生計画認可の決定が確定したときにおける更正計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

### ③民事再生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について民事再生手続開始の決定がなされ、かつ簡易再生または同意再生の決定がなされることなく再生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、民事再生計画認可の決定が確定したときにおける再生計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

### ④日本法によらない破産、会社更生及び民事再生の場合

当社について、日本法によらない破産手続、会社更生手続、民事再生手続またはこれに準ずる手続が外国において本劣後特約（１）①ないし③に準じて行われる場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、その手続において本劣後特約（１）①ないし③の停止条件に準ずる条件が成就したときに、その手続上発生するものとする。ただし、その手続上そのような条件を付すことが認められない場合には、当該条件にかかることなく発生するものとする。

（２）本社債の社債要項の各条項は、いかなる意味においても、劣後債権の債権者以外の当社の債権者に対して不利益を及ぼす内容にこれを変更してはならず、かかる変更の合意はいかなる意味においても、またいかなる者に対しても効力を生じない。

（３）本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（１）①ないし④に従って停止しているにもかかわらず、当該元利金の全部または一部が社債権者に支払われた場合には、その支払いは無効とし、社債権者はその受領した元利金をただちに当社に返還する。

（４）本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（１）①ないし④に従って停止している間は、本社債に基づく元利金の支払請求権を相殺の対象とすることはできない。

（５）本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（１）①ないし④に従って停止したために当該元利金の支払いが本社債の社債要項に定めた期日に遅れた場合には、社債権者は当該遅滞に関して利息その他の支払いを請求することが出来ない。

（６）当社について破産手続が開始された場合、当該破産手続における本社債に基づく元利金の支払請求権の配当の順位は、破産法に規定する劣後的破産債権に後れるものとする。

#### 4. 野村ホールディングス株式会社 第2回無担保社債(劣後特約付)

自己資本調達手段 (劣後債)

|    |  |                                |
|----|--|--------------------------------|
| 1  | 発行者  | 野村ホールディングス株式会社                 |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号  | JP376260AAB8                   |
| 3  | 準拠法  | 日本法                            |
|    | 規制上の取扱い (1)  |                                |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | Tier2 資本に係る基礎項目の額              |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | 無                              |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (2)  |                                |
| 7  | 銘柄、名称又は種類  | 野村ホールディングス株式会社第2回無担保社債 (劣後特約付) |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (3)<br>連結自己資本規制比率   | 35,550百万円                      |
| 9  | 額面総額 (4)   | 39,500百万円                      |
| 10 | 表示される科目の区分 (5)<br>連結貸借対照表  | 負債<br>負債                       |
| 11 | 発行日 (6)  | 平成22年11月26日                    |
| 12 | 償還期限の有無  | 有                              |
| 13 | その日付   | 平成37年11月26日                    |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無   | 無                              |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額 (7)<br>特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (8)                                |                                |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (9)   |                                |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払  |                                |
| 17 | 配当率又は利率の種類 (10)  | 固定                             |
| 18 | 配当率又は利率 (11)   | 年2.649パーセント                    |
| 19 | 配当等停止条項の有無 (12)  | 無                              |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (13)  | 裁量なし                           |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無   | 無                              |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無   | 無                              |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無  | 無                              |
| 24 | 転換が生じる場合 (14)  |                                |
| 25 | 転換の範囲 (15)   |                                |
| 26 | 転換の比率 (16)   |                                |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無 (17)  |                                |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類   |                                |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者  |                                |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無 (18)   | 無                              |
| 31 | 元本の削減が生じる場合 (19)   |                                |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲 (20)   |                                |
| 33 | 元本回復特約の有無 (21)   |                                |
| 34 | その概要   |                                |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (22) | 一般債務                           |
| 36 | 非充足資本要件の有無 (23)  | 有                              |
| 37 | 非充足資本要件の内容 (23)  | 実質破綻認定時損失吸収条項                  |

## ■その他の契約内容

### 担保・保証の有無

本社債には担保及び保証は付されておらず、また本社債のために特に留保されている資産はない。

### 期限の利益喪失に関する特約

- (1) 本社債は期限の利益喪失に関する特約を付さない。
- (2) 本社債の社債権者は、会社法第739条に定める決議を行う権利を有さず、本社債が同条に基づき期限の利益を喪失せしめられることはない。

### 劣後特約

- (1) 次の各場合には、本社債の償還及び利息の支払いは以下の規定に従って行われる。

#### ①破産の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について破産手続開始の決定がなされ、かつ破産手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

その破産手続の最後の配当のための配当表（更正された場合は、更正後のもの）に記載された配当に加えるべき債権のうち、劣後債権を除く全ての債権が、各中間配当、最後の配当及び追加配当によって、その債権額につき全額の満足（配当及び供託を含む。）を受けたこと。

#### ②会社更生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について会社更生手続開始の決定がなされ、かつ更生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、会社更生計画認可の決定が確定したときにおける更正計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ③民事再生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について民事再生手続開始の決定がなされ、かつ簡易再生または同意再生の決定がなされることなく再生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、民事再生計画認可の決定が確定したときにおける再生計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ④日本法によらない破産、会社更生及び民事再生の場合

当社について、日本法によらない破産手続、会社更生手続、民事再生手続またはこれに準ずる手続が外国において本劣後特約（1）①ないし③に準じて行われる場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、その手続において本劣後特約（1）①ないし③の停止条件に準ずる条件が成就したときに、その手続上発生するものとする。ただし、その手続上そのような条件を付すことが認められない場合には、当該条件にかかることなく発生するものとする。

(2) 本社債の社債要項の各条項は、いかなる意味においても、劣後債権の債権者以外の当社の債権者に対して不利益を及ぼす内容にこれを変更してはならず、かかる変更の合意はいかなる意味においても、またいかなる者に対しても効力を生じない。

(3) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止しているにもかかわらず、当該元利金の全部または一部が社債権者に支払われた場合には、その支払いは無効とし、社債権者はその受領した元利金をただちに当社に返還する。

(4) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止している間は、本社債に基づく元利金の支払請求権を相殺の対象とすることはできない。

(5) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止したために当該元利金の支払いが本社債の社債要項に定めた期日に遅れた場合には、社債権者は当該遅滞に関して利息その他の支払いを請求することが出来ない。

(6) 当社について破産手続が開始された場合、当該破産手続における本社債に基づく元利金の支払請求権の配当の順位は、破産法に規定する劣後的破産債権に後れるものとする。

## 5. 野村ホールディングス株式会社 第3回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)

### 自己資本調達手段 (劣後債)

|    |  |   |
|----|--|---|
| 1  | 発行者  | 野村ホールディングス株式会社  |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号  | JP376260BAB6  |
| 3  | 準拠法  | 日本法   |
|    | 規制上の取扱い (1)  |   |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | Tier2 資本に係る基礎項目の額   |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | 無   |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (2)  |   |
| 7  | 銘柄、名称又は種類  | 野村ホールディングス株式会社第3回期限前償還条項付無担保社債 (劣後特約付)  |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (3)   |   |
|    | 連結自己資本規制比率   | 51,030百万円   |
| 9  | 額面総額 (4)   | 57,700百万円   |
| 10 | 表示される科目の区分 (5)   | 負債  |
|    | 連結貸借対照表  | 負債  |
| 11 | 発行日 (6)  | 平成22年11月26日   |
| 12 | 償還期限の有無  | 有   |
| 13 | その日付   | 平成37年11月26日   |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無   | 有   |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額 (7)  | 初回償還可能日:平成32年11月26日<br>償還金額:各社債の金額100円につき100円                                 |
|    | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (8)   | 無   |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (9)   | 平成32年11月26日以降に到来するいずれかの利息の支払期日 (毎年5月26日および11月26日 (当該日が銀行休業日にあたるときは、その前銀行営業日)) |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払  |   |
| 17 | 配当率又は利率の種別 (10)  | 固定  |
| 18 | 配当率又は利率 (11)   | 年2.749パーセント   |
| 19 | 配当等停止条項の有無 (12)  | 無   |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (13)  |   |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無   | 無   |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無   | 無   |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無  | 無   |
| 24 | 転換が生じる場合 (14)  |   |
| 25 | 転換の範囲 (15)   |   |
| 26 | 転換の比率 (16)   |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無 (17)  |   |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類   |   |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者  |   |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無 (18)   | 無   |
| 31 | 元本の削減が生じる場合 (19)   |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲 (20)   |   |
| 33 | 元本回復特約の有無 (21)   |   |
| 34 | その概要   |   |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (22) | 一般債務  |
| 36 | 非充足資本要件の有無 (23)  | 有   |
| 37 | 非充足資本要件の内容 (23)  | 実質破綻認定時損失吸収条項   |

## ■その他の契約内容

### 担保・保証の有無

本社債には担保及び保証は付されておらず、また本社債のために特に留保されている資産はない。

### 期限の利益喪失に関する特約

- (1) 本社債は期限の利益喪失に関する特約を付さない。
- (2) 本社債の社債権者は、会社法第739条に定める決議を行う権利を有さず、本社債が同条に基づき期限の利益を喪失せしめられることはない。

### 劣後特約

- (1) 次の各場合には、本社債の償還及び利息の支払いは以下の規定に従って行われる。

#### ①破産の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について破産手続開始の決定がなされ、かつ破産手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

その破産手続の最後の配当のための配当表（更正された場合は、更正後のもの）に記載された配当に加えるべき債権のうち、劣後債権を除く全ての債権が、各中間配当、最後の配当及び追加配当によって、その債権額につき全額の満足（配当及び供託を含む。）を受けたこと。

#### ②会社更生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について会社更生手続開始の決定がなされ、かつ更生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、会社更生計画認可の決定が確定したときにおける更正計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ③民事再生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について民事再生手続開始の決定がなされ、かつ簡易再生または同意再生の決定がなされることなく再生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、民事再生計画認可の決定が確定したときにおける再生計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ④日本法によらない破産、会社更生及び民事再生の場合

当社について、日本法によらない破産手続、会社更生手続、民事再生手続またはこれに準ずる手続が外国において本劣後特約（1）①ないし③に準じて行われる場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、その手続において本劣後特約（1）①ないし③の停止条件に準ずる条件が成就したときに、その手続上発生するものとする。ただし、その手続上そのような条件を付すことが認められない場合には、当該条件にかかることなく発生するものとする。

(2) 本社債の社債要項の各条項は、いかなる意味においても、劣後債権の債権者以外の当社の債権者に対して不利益を及ぼす内容にこれを変更してはならず、かかる変更の合意はいかなる意味においても、またいかなる者に対しても効力を生じない。

(3) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止しているにもかかわらず、当該元利金の全部または一部が社債権者に支払われた場合には、その支払いは無効とし、社債権者はその受領した元利金をただちに当社に返還する。

(4) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止している間は、本社債に基づく元利金の支払請求権を相殺の対象とすることはできない。

(5) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止したために当該元利金の支払いが本社債の社債要項に定めた期日に遅れた場合には、社債権者は当該遅滞に関して利息その他の支払いを請求することが出来ない。

(6) 当社について破産手続が開始された場合、当該破産手続における本社債に基づく元利金の支払請求権の配当の順位は、破産法に規定する劣後的破産債権に後れるものとする。

## 6. 野村ホールディングス株式会社 第4回期限前償還条項付無担保変動利付社債(劣後特約付)

自己資本調達手段 (劣後債)

|    |  |  |
|----|--|--|
| 1  | 発行者  | 野村ホールディングス株式会社   |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号  | JP376260CAB4   |
| 3  | 準拠法  | 日本法  |
|    | 規制上の取扱い (1)  |  |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | Tier2 資本に係る基礎項目の額  |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | 無  |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (2)  |  |
| 7  | 銘柄、名称又は種類  | 野村ホールディングス株式会社第4回期限前償還条項付無担保変動利付社債 (劣後特約付)                                   |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (3)   |  |
|    | 連結自己資本規制比率   | 5,400百万円   |
| 9  | 額面総額 (4)   | 6,000百万円   |
| 10 | 表示される科目の区分 (5)   | 負債   |
|    | 連結貸借対照表  | 負債   |
| 11 | 発行日 (6)  | 平成22年11月26日  |
| 12 | 償還期限の有無  | 有  |
| 13 | その日付   | 平成37年11月26日  |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無   | 有  |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額 (7)  | 初回償還可能日:平成32年11月26日<br>償還金額:各社債の金額100円につき100円                                |
|    | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (8)   | 無  |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (9)   | 平成32年11月26日以降に到来するいずれかの利息の支払期日 (毎年5月26日および11月26日 (当該日が銀行休業日にあたる時は、その前銀行営業日)) |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払  |  |
| 17 | 配当率又は利率の種別 (10)  | 変動   |
| 18 | 配当率又は利率 (11)   | 6か月物ユーロ円LIBOR + 1.0パーセント   |
| 19 | 配当等停止条項の有無 (12)  | 無  |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (13)  | 裁量なし   |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無   | 無  |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無   | 無  |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無  | 無  |
| 24 | 転換が生じる場合 (14)  |  |
| 25 | 転換の範囲 (15)   |  |
| 26 | 転換の比率 (16)   |  |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無 (17)  |  |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類   |  |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者  |  |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無 (18)   | 無  |
| 31 | 元本の削減が生じる場合 (19)   |  |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲 (20)   |  |
| 33 | 元本回復特約の有無 (21)   |  |
| 34 | その概要   |  |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (22) | 一般債務   |
| 36 | 非充足資本要件の有無 (23)  | 有  |
| 37 | 非充足資本要件の内容 (23)  | 実質破綻認定時損失吸収条項  |

## ■その他の契約内容

### 担保・保証の有無

本社債には担保及び保証は付されておらず、また本社債のために特に留保されている資産はない。

### 期限の利益喪失に関する特約

- (1) 本社債は期限の利益喪失に関する特約を付さない。
- (2) 本社債の社債権者は、会社法第739条に定める決議を行う権利を有さず、本社債が同条に基づき期限の利益を喪失せしめられることはない。

### 劣後特約

- (1) 次の各場合には、本社債の償還及び利息の支払いは以下の規定に従って行われる。

#### ①破産の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について破産手続開始の決定がなされ、かつ破産手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

その破産手続の最後の配当のための配当表（更正された場合は、更正後のもの）に記載された配当に加えるべき債権のうち、劣後債権を除く全ての債権が、各中間配当、最後の配当及び追加配当によって、その債権額につき全額の満足（配当及び供託を含む。）を受けたこと。

#### ②会社更生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について会社更生手続開始の決定がなされ、かつ更生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、会社更生計画認可の決定が確定したときにおける更正計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ③民事再生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について民事再生手続開始の決定がなされ、かつ簡易再生または同意再生の決定がなされることなく再生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、民事再生計画認可の決定が確定したときにおける再生計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ④日本法によらない破産、会社更生及び民事再生の場合

当社について、日本法によらない破産手続、会社更生手続、民事再生手続またはこれに準ずる手続が外国において本劣後特約（1）①ないし③に準じて行われる場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、その手続において本劣後特約（1）①ないし③の停止条件に準ずる条件が成就したときに、その手続上発生するものとする。ただし、その手続上そのような条件を付すことが認められない場合には、当該条件にかかることなく発生するものとする。

(2) 本社債の社債要項の各条項は、いかなる意味においても、劣後債権の債権者以外の当社の債権者に対して不利益を及ぼす内容にこれを変更してはならず、かかる変更の合意はいかなる意味においても、またいかなる者に対しても効力を生じない。

(3) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止しているにもかかわらず、当該元利金の全部または一部が社債権者に支払われた場合には、その支払いは無効とし、社債権者はその受領した元利金をただちに当社に返還する。

(4) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止している間は、本社債に基づく元利金の支払請求権を相殺の対象とすることはできない。

(5) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止したために当該元利金の支払いが本社債の社債要項に定めた期日に遅れた場合には、社債権者は当該遅滞に関して利息その他の支払いを請求することが出来ない。

(6) 当社について破産手続が開始された場合、当該破産手続における本社債に基づく元利金の支払請求権の配当の順位は、破産法に規定する劣後的破産債権に後れるものとする。

## 7. 野村ホールディングス株式会社 第5回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)

自己資本調達手段（劣後債）

|    |   |   |
|----|---|---|
| 1  | 発行者   | 野村ホールディングス株式会社  |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号   | JP376260AAC6  |
| 3  | 準拠法   | 日本法   |
|    | 規制上の取扱い（1）  |   |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | Tier2 資本に係る基礎項目の額   |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | 無   |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者（2）  |   |
| 7  | 銘柄、名称又は種類   | 野村ホールディングス株式会社第5回期限前償還条項付無担保社債（劣後特約付）                                       |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額（3）   |   |
|    | 連結自己資本規制比率  | 45,000百万円   |
| 9  | 額面総額（4）   | 50,000百万円   |
| 10 | 表示される科目の区分（5）   | 負債  |
|    | 連結貸借対照表   | 負債  |
| 11 | 発行日（6）  | 平成22年12月6日  |
| 12 | 償還期限の有無   | 有   |
| 13 | その日付  | 平成37年11月26日   |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無  | 有   |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額（7）  | 初回償還可能日：平成32年11月26日<br>償還金額：各社債の金額100円につき100円                               |
|    | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額（8）   | 無   |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要（9）   | 平成32年11月26日以降に到来するいずれかの利息の支払期日（毎年5月26日および11月26日（当該日が銀行休業日にあたるときは、その前銀行営業日）） |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払   |   |
| 17 | 配当率又は利率の種別（10）  | 固定  |
| 18 | 配当率又は利率（11）   | 年2.773パーセント   |
| 19 | 配当等停止条項の有無（12）  | 無   |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無（13）  | 裁量なし  |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無  | 無   |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無  | 無   |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無   | 無   |
| 24 | 転換が生じる場合（14）  |   |
| 25 | 転換の範囲（15）   |   |
| 26 | 転換の比率（16）   |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無（17）  |   |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類  |   |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者   |   |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無（18）   | 無   |
| 31 | 元本の削減が生じる場合（19）   |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲（20）   |   |
| 33 | 元本回復特約の有無（21）   |   |
| 34 | その概要  |   |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類（22） | 一般債務  |
| 36 | 非充足資本要件の有無（23）  | 有   |
| 37 | 非充足資本要件の内容（23）  | 実質破綻認定時損失吸収条項   |

## ■その他の契約内容

### 担保・保証の有無

本社債には担保及び保証は付されておらず、また本社債のために特に留保されている資産はない。

### 期限の利益喪失に関する特約

- (1) 本社債は期限の利益喪失に関する特約を付さない。
- (2) 本社債の社債権者は、会社法第739条に定める決議を行う権利を有さず、本社債が同条に基づき期限の利益を喪失せしめられることはない。

### 劣後特約

- (1) 次の各場合には、本社債の償還及び利息の支払いは以下の規定に従って行われる。

#### ①破産の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について破産手続開始の決定がなされ、かつ破産手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

その破産手続の最後の配当のための配当表（更正された場合は、更正後のもの）に記載された配当に加えるべき債権のうち、劣後債権を除く全ての債権が、各中間配当、最後の配当及び追加配当によって、その債権額につき全額の満足（配当及び供託を含む。）を受けたこと。

#### ②会社更生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について会社更生手続開始の決定がなされ、かつ更生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、会社更生計画認可の決定が確定したときにおける更正計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ③民事再生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、当社について民事再生手続開始の決定がなされ、かつ簡易再生または同意再生の決定がなされることなく再生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

当社について、民事再生計画認可の決定が確定したときにおける再生計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ④日本法によらない破産、会社更生及び民事再生の場合

当社について、日本法によらない破産手続、会社更生手続、民事再生手続またはこれに準ずる手続が外国において本劣後特約（1）①ないし③に準じて行われる場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、その手続において本劣後特約（1）①ないし③の停止条件に準ずる条件が成就したときに、その手続上発生するものとする。ただし、その手続上そのような条件を付すことが認められない場合には、当該条件にかかることなく発生するものとする。

(2) 本社債の社債要項の各条項は、いかなる意味においても、劣後債権の債権者以外の当社の債権者に対して不利益を及ぼす内容にこれを変更してはならず、かかる変更の合意はいかなる意味においても、またいかなる者に対しても効力を生じない。

(3) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止しているにもかかわらず、当該元利金の全部または一部が社債権者に支払われた場合には、その支払いは無効とし、社債権者はその受領した元利金をただちに当社に返還する。

(4) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止している間は、本社債に基づく元利金の支払請求権を相殺の対象とすることはできない。

(5) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし④に従って停止したために当該元利金の支払いが本社債の社債要項に定めた期日に遅れた場合には、社債権者は当該遅滞に関して利息その他の支払いを請求することが出来ない。

(6) 当社について破産手続が開始された場合、当該破産手続における本社債に基づく元利金の支払請求権の配当の順位は、破産法に規定する劣後的破産債権に後れるものとする。

## 8. 野村證券株式会社 第3回無担保社債(劣後特約付)

自己資本調達手段 (劣後債)

|    |  |                          |
|----|--|--------------------------|
| 1  | 発行者  | 野村證券株式会社                 |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号  | JP376261B834             |
| 3  | 準拠法  | 日本法                      |
|    | 規制上の取扱い (1)  |                          |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | Tier2 資本に係る基礎項目の額        |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | 無                        |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (2)  |                          |
| 7  | 銘柄、名称又は種類  | 野村證券株式会社第3回無担保社債 (劣後特約付) |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (3)   |                          |
|    | 連結自己資本規制比率   | 44,135百万円                |
| 9  | 額面総額 (4)   | 49,200百万円                |
| 10 | 表示される科目の区分 (5)   | 負債                       |
|    | 連結貸借対照表  | 負債                       |
| 11 | 発行日 (6)  | 平成20年3月26日               |
| 12 | 償還期限の有無  | 有                        |
| 13 | その日付   | 平成30年3月26日               |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無   | 無                        |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額 (7)  |                          |
|    | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (8)   |                          |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (9)   |                          |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払  |                          |
| 17 | 配当率又は利率の種類別 (10)   | 固定                       |
| 18 | 配当率又は利率 (11)   | 年2.28パーセント               |
| 19 | 配当等停止条項の有無 (12)  | 無                        |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (13)  | 裁量なし                     |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無   | 無                        |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無   | 無                        |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無  | 無                        |
| 24 | 転換が生じる場合 (14)  |                          |
| 25 | 転換の範囲 (15)   |                          |
| 26 | 転換の比率 (16)   |                          |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無 (17)  |                          |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類   |                          |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者  |                          |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無 (18)   | 無                        |
| 31 | 元本の削減が生じる場合 (19)   |                          |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲 (20)   |                          |
| 33 | 元本回復特約の有無 (21)   |                          |
| 34 | その概要   |                          |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (22) | 一般債務                     |
| 36 | 非充足資本要件の有無 (23)  | 有                        |
| 37 | 非充足資本要件の内容 (23)  | 実質破綻認定時損失吸収条項            |

## ■その他の契約内容

### 担保・保証の有無

本社債には担保及び保証は付されておらず、また本社債のために特に留保されている資産はない。

### 財務上の特約

担保提供制限条項その他の条項は付されていない。

### 期限の利益喪失に関する特約

- (1) 本社債は期限の利益喪失に関する特約を付さない。
- (2) 本社債の社債権者は、会社法第739条に定める決議を行う権利を有さず、本社債が同条に基づき期限の利益を喪失せしめられることはない。

### 劣後特約

- (1) 次の各場合には、本社債の償還及び利息の支払いは以下の規定に従って行われる。

#### ①破産の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、発行者について破産手続開始の決定がなされ、かつ破産手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

その破産手続の最後の配当のための配当表（更正された場合は、更正後のもの）に記載された配当に加えるべき債権のうち、劣後債権を除く全ての債権が、各中間配当、最後の配当及び追加配当によって、その債権額につき全額の満足（配当及び供託を含む。）を受けたこと。

#### ②会社更生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、発行者について会社更生手続開始の決定がなされ、かつ更生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

発行者について、会社更生計画認可の決定が確定したときにおける更正計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ③民事再生の場合

本社債につき定められた元利金の弁済期限以前において、発行者について民事再生手続開始の決定がなされ、かつ簡易再生または同意再生の決定がなされることなく再生手続が継続している場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

発行者について、民事再生計画認可の決定が確定したときにおける再生計画に記載された変更されるべき権利のうち、劣後債権を除く全ての債権が、その確定した債権額について全額の弁済をうけたこと。

#### ④日本法によらない破産、会社更生及び民事再生の場合

発行者について、日本法によらない破産手続、会社更生手続、民事再生手続またはこれに準ずる手続が外国において本劣後特約（1）①ないし③に準じて行われる場合、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、その手続において本劣後特約（1）①ないし③の停止条件に準ずる条件が成就したときに、その手続上発生するものとする。ただし、その手続上そのような条件を付すことが認められない場合には、当該条件にかかることなく発生するものとする。

#### ⑤自己資本規制比率を充足しない場合

発行者が本社債の元利金の支払いを行うことにより金融商品取引法第46条の6第2項の規定（金融商品取引法に定める金融商品取引業者の自己資本規制比率に関する規定が改正された場合には、改正後の規定を指すものとする。以下同じ。）に違反することになる場合には、本社債に基づく元利金の支払請求権の効力は停止し、以下の条件が成就したときに発生する。

(停止条件)

発行者が当該元利金の支払いを行っても金融商品取引法第46条の6第2項に違反しなくなること。

(2) 本社債の社債要項の各条項は、いかなる意味においても、劣後債権の債権者以外の発行者の債権者に対して不利益を及ぼす内容にこれを変更してはならず、かかる変更の合意はいかなる意味においても、またいかなる者に対しても効力を生じない。

(3) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし⑤に従って停止しているにもかかわらず、当該元利金の全部または一部が社債権者に支払われた場合には、その支払いは無効とし、社債権者はその受領した元利金をただちに発行者に返還する。

(4) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし⑤に従って停止している間は、本社債に基づく元利金の支払請求権を相殺の対象とすることはできない。

(5) 本社債に基づく元利金の支払請求権の効力が本劣後特約（1）①ないし⑤に従って停止したために当該元利金の支払いが本社債の社債要項に定めた期日に遅れた場合には、社債権者は当該遅滞に関して利息その他の支払いを請求することが出来ない。

## 9. 野村證券株式会社 劣後特約付借入金

自己資本調達手段（劣後ローン）

|    |   |                   |
|----|---|-------------------|
| 1  | 発行者   | 野村證券株式会社          |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号   | 無                 |
| 3  | 準拠法   | 日本法               |
|    | 規制上の取扱い（1）  |                   |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | Tier2 資本に係る基礎項目の額 |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | 無                 |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者（2）  |                   |
| 7  | 銘柄、名称又は種類   | 劣後特約付借入金          |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額（3）   |                   |
|    | 連結自己資本規制比率  | 90,000百万円         |
| 9  | 額面総額（4）   |                   |
| 10 | 表示される科目の区分（5）   | 負債                |
|    | 連結貸借対照表   | 負債                |
| 11 | 発行日（6）  | 平成20年6月25日        |
| 12 | 償還期限の有無   | 有                 |
| 13 | その日付  | 平成30年6月25日        |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無  | 無                 |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額（7）  |                   |
|    | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額（8）   |                   |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要（9）   |                   |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払   |                   |
| 17 | 配当率又は利率の種別（10）  | 変動                |
| 18 | 配当率又は利率（11）   | 2.4パーセント ※注1      |
| 19 | 配当等停止条項の有無（12）  | 無                 |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無（13）  | 裁量なし              |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無  | 無                 |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無  | 無                 |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無   | 無                 |
| 24 | 転換が生じる場合（14）  |                   |
| 25 | 転換の範囲（15）   |                   |
| 26 | 転換の比率（16）   |                   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無（17）  |                   |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類  |                   |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者   |                   |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無（18）   | 無                 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合（19）   |                   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲（20）   |                   |
| 33 | 元本回復特約の有無（21）   |                   |
| 34 | その概要  |                   |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類（22） | 一般債務              |
| 36 | 非充足資本要件の有無（23）  | 有                 |
| 37 | 非充足資本要件の内容（23）  | 実質破綻認定時損失吸収条項     |

注1) 平成25年9月末時点の劣後調達全体の利率の加重平均値を表示しております。

## 10. 野村證券株式会社 劣後特約付借入金

自己資本調達手段（劣後ローン）

|    |   |                   |
|----|---|-------------------|
| 1  | 発行者   | 野村證券株式会社          |
| 2  | 識別のために付された番号、記号その他の符号   | 無                 |
| 3  | 準拠法   | 日本法               |
|    | 規制上の取扱い（1）  |                   |
| 4  | 平成34年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い  | Tier2 資本に係る基礎項目の額 |
| 5  | 平成34年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い   | 無                 |
| 6  | 連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者（2）  |                   |
| 7  | 銘柄、名称又は種類   | 劣後特約付借入金          |
| 8  | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額（3）   |                   |
|    | 連結自己資本規制比率  | 9,000百万円          |
| 9  | 額面総額（4）   |                   |
| 10 | 表示される科目の区分（5）   | 負債                |
|    | 連結貸借対照表   | 負債                |
| 11 | 発行日（6）  | 平成20年6月30日        |
| 12 | 償還期限の有無   | 有                 |
| 13 | その日付  | 平成30年6月29日        |
| 14 | 償還等を可能とする特約の有無  | 無                 |
| 15 | 初回償還可能日及びその償還金額（7）  |                   |
|    | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額（8）   |                   |
| 16 | 任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要（9）   |                   |
|    | 剰余金の配当又は利息の支払   |                   |
| 17 | 配当率又は利率の種別（10）  | 固定                |
| 18 | 配当率又は利率（11）   | 2.4パーセント ※注1      |
| 19 | 配当等停止条項の有無（12）  | 無                 |
| 20 | 剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無（13）  | 裁量なし              |
| 21 | ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無  | 無                 |
| 22 | 未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無  | 無                 |
| 23 | 他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無   | 無                 |
| 24 | 転換が生じる場合（14）  |                   |
| 25 | 転換の範囲（15）   |                   |
| 26 | 転換の比率（16）   |                   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無（17）  |                   |
| 28 | 転換に際して交付される資本調達手段の種類  |                   |
| 29 | 転換に際して交付される資本調達手段の発行者   |                   |
| 30 | 元本の削減に係る特約の有無（18）   | 無                 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合（19）   |                   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲（20）   |                   |
| 33 | 元本回復特約の有無（21）   |                   |
| 34 | その概要  |                   |
| 35 | 残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類（22） | 一般債務              |
| 36 | 非充足資本要件の有無（23）  | 有                 |
| 37 | 非充足資本要件の内容（23）  | 実質破綻認定時損失吸収条項     |

注1) 平成25年9月末時点の劣後調達全体の利率の加重平均値を表示しております。