

2016年9月末
連結自己資本規制および
連結流動性規制に関する開示

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基づき行う開示

事業年度 自 2016年4月1日
(第113期) 至 2016年9月30日

野村ホールディングス株式会社

目次

第1部 連結自己資本規制に関する開示	3
第1章 自己資本の構成に関する開示事項	4
第2章 定性的な開示事項	9
1. 連結の範囲	9
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	11
第3章 定量的な開示事項	12
1. その他金融機関等であつて、最終指定親会社の子法人等であるものの自己資本	12
2. 連結自己資本規制比率に関する事項	12
3. 自己資本の充実度に関する事項	13
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	14
5. 信用リスク削減手法に関する事項	20
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	20
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	22
8. マーケット・リスクに関する事項	24
9. トレーディング業務以外の出資等または株式等エクスポージャーに関する事項	25
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または経済的価値の増減に関する事項	25
第4章 自己資本調達手段に関する契約内容	26
1. 野村ホールディングス株式会社 普通株式	26
2. 野村ホールディングス株式会社 第1回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約及び劣後特約付適格機関投資家限定)	27
3. 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)	30
4. 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)	33
5. 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)	36
6. 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)	38
7. 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)	41
8. 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)	44
9. 野村証券株式会社 第3回無担保社債(劣後特約付)	47
10. 野村証券株式会社 劣後特約付借入金	50
11. 野村証券株式会社 劣後特約付借入金	51
12. キャピタル・ノムラ・セキュリティーズ・パブリック CO., LTD 非支配持分	52
13. Nomura Asset Management Taiwan Ltd. 非支配持分	53

14. Nomura Asia Investment (Viet Nam) Pte Ltd 非支配持分	54
15. Chi-X Global Holdings LLC 非支配持分	55
16. 株式会社杉村倉庫 非支配持分	56
17. Shanghai Nomura Lujiazui Investment Management Co., Ltd. 非支配持分	57
18. 株式会社ウエルス・スクエア 非支配持分	58
第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項	60
第2部 連結流動性規制に関する開示	61
第1章 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項	62
第2章 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項	63
1. 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項	63
2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項	63
3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項	63
4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項	63

第1部 連結自己資本規制に関する開示

(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〕

第1章 自己資本の構成に関する開示事項

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2016年9月末		2016年6月末	
		当最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額	前最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額
普通株式等 Tier1 資本に係る基礎項目 (1)					
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	2,668,600		2,655,527	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	1,282,937		1,284,352	
2	うち、利益剰余金の額	1,554,182		1,526,834	
1c	うち、自己株式の額 (△)	168,519		155,659	
26	うち、社外流出予定額 (△)	-		-	
	うち、上記以外に該当するものの額	-		-	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	-		-	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	△39,553	△26,369	△30,957	△20,638
5	普通株式等 Tier1 資本に係る調整後非支配株主持分の額	-		-	
	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	3,019		3,053	
6	普通株式等 Tier1 資本に係る基礎項目の額 (イ)	2,632,066		2,627,623	
普通株式等 Tier1 資本に係る調整項目 (2)					
8+9	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	114,925	76,617	117,445	78,297
8	うち、のれんに係るもの (のれん相当差額を含む。)の額	43,822	29,214	44,450	29,633
9	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	71,104	47,403	72,995	48,663
10	繰延税金資産 (一時差異に係るものを除く。)の額	5,239	3,493	5,742	3,828
11	繰延ヘッジ損益の額	-	-	-	-
12	適格引当金不足額	15,494	10,330	14,420	9,613
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	-	-	-	-
14	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	8,476	5,651	14,783	9,855
15	退職給付に係る資産の額	11,354	7,569	11,071	7,380
16	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	741	494	612	408
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	-	-	-	-
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	-	-	-	-
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	-	-	-
19	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	-	-	-	-

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2016年9月末		2016年6月末	
		当最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額	前最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額
20	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	-	-	-	-
21	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	-	-	-	-
22	特定項目に係る十五パーセント基準超過額	-	-	-	-
23	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	-	-	-	-
24	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	-	-	-	-
25	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	-	-	-	-
27	その他 Tier1 資本不足額	-		-	
28	普通株式等 Tier1 資本に係る調整項 目の額 (ロ)	156,229		164,072	
普通株式等 Tier1 資本					
29	普通株式等 Tier1 資本の額 ((イ) - (ハ) (ロ))	2,475,836		2,463,550	
その他 Tier1 資本に係る基礎項目 (3)					
31a	30 その他 Tier1 資本調達手段に係る株主資本の 額	-		-	
31b		-		-	
32		165,000		165,000	
		-		-	
34-35	その他 Tier1 資本調達手段に係る調整後非支 配株主持分等の額	1,053		1,128	
33+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	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	-		-	
35	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	-		-	
	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	△26,369		△20,638	
	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	△26,369		△20,638	
36	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の 額 (二)	139,684		145,490	
その他 Tier1 資本に係る調整項目					
37	自己保有その他 Tier1 資本調達手段の額	-	-	-	-

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2016年9月末		2016年6月末	
		当最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額	前最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額
38	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	-	-	-	-
39	少数出資金融機関等のその他 Tier1 資本調達 手段の額	-	-	-	-
40	その他金融機関等のその他 Tier1 資本調達手 段の額	3,001	2,001	3,001	2,001
	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	46,271		50,951	
	うち、無形固定資産(のれんに係るもの に限る)の額	29,214		29,633	
	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	6,241		6,656	
	うち、期待損失額の対適格引当金超過額 を2で除した額	5,165		4,807	
	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	5,651		9,855	
42	Tier2 資本不足額	-		-	
43	その他 Tier1 資本に係る調整項目の 額 (ホ)	49,272		53,952	
	その他 Tier1 資本				
44	その他 Tier1 資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	90,412		91,538	
	Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	2,566,248		2,555,088	
	Tier2 資本に係る基礎項目 (4)				
46	Tier2 資本調達手段に係る株主資本の額	-		-	
	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	169,579		169,395	
	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非支配株主 持分等の額	248		265	
47+49	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	144,078		152,099	
47	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	91,320		91,320	
49	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	52,758		60,779	
50	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	-		-	
50a	うち、一般貸倒引当金 Tier2 算入額	-		-	
50b	うち、適格引当金 Tier2 算入額	-		-	

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2016年9月末		2016年6月末	
		当最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額	前最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額
	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	-		-	
51	Tier2 資本に係る基礎項目の額 (チ)	313,905		321,760	
Tier2 資本に係る調整項目					
52	自己保有 Tier2 資本調達手段の額	-	-	-	-
53	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	-	-	-	-
54	少数出資金融機関等の Tier2 資本調達手段の 額	-	-	-	-
55	その他金融機関等の Tier2 資本調達手段の額	170	114	171	114
	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	7,279		6,921	
	うち、他の金融機関等の資本調達手段の 額	2,114		2,115	
	うち、期待損失額の対適格引当金超過額 を2で除した額	5,165		4,807	
57	Tier2 資本に係る調整項目の額 (リ)	7,450		7,092	
Tier2 資本					
58	Tier2 資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	306,455		314,667	
総自己資本					
59	総自己資本合計 ((ト) + (ヌ)) (ル)	2,872,704		2,869,756	
リスク・アセット (5)					
	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	52,717		53,624	
	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	41,161		42,007	
	うち、繰延税金資産(一時差異に係るもの を除く)の額	3,493		3,828	
	うち、退職給付に係る資産の額	7,569		7,380	
	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	494		408	
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	13,706,313		15,036,371	
連結自己資本規制比率					
61	連結普通株式等 Tier1 比率 ((ハ) / (ヲ))	18.0%		16.3%	
62	連結 Tier1 比率 ((ト) / (ヲ))	18.7%		16.9%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	20.9%		19.0%	
調整項目に係る参考事項(6)					
72	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	123,932		117,715	
73	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	190,399		187,447	

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2016年9月末		2016年6月末	
		当最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額	前最終指定 親会社 四半期末	経過措置によ る不算入額
74	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	-		-	
75	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	56,025		61,381	
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）					
76	一般貸倒引当金の額	-		-	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上 限額	-		-	
78	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。）	-		-	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-		-	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項（8）					
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-		-	
83	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。）	-		-	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	186,792		186,792	
85	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。）	60,880		60,880	

第2章 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・アセットの額またはマーケット・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

2016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・サービシズ株式会社(日本・証券業)など194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、2016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3,893億円、純資産586億円)、Nomura Reinsurance ICC Limited(ガーンジー、保険業、総資産0.4億円、純資産0.4億円)、Nomura Reinsurance 1 IC Limited(ガーンジー、保険業、総資産407億円、純資産11億円)、Nomura Reinsurance 3 IC Limited(ガーンジー、保険業、総資産80億円、純資産3億円)、Nomura Reinsurance 5IC Limited(ガーンジー、保険業、総資産46億円、純資産7億円)、US CB Reinsurance 1 IC Limited(ガーンジー、保険業、総資産10億円、純資産10億円)、US CB Reinsurance 2 IC Limited(ガーンジー、保険業、総資産6億円、純資産6億円)、Nomura Americas Re Ltd.(バミューダ、保険業、総資産33億円、純資産31億円)、Nomura Americas US Re Ltd.(バミューダ、保険業、総資産7億円、純資産3億円)、その他VIE1,125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

(単位:百万円)

	連結規制貸借対照表の各項目の額		第1章の対応項目(国際様式の該当項目)
	当最終指定親会社四半期末 (2016年9月末)	前最終指定親会社四半期末 (2016年6月末)	
資産			
現金・預金	3,387,274	2,335,211	
貸付金および受取債権	2,727,747	3,158,985	
担保付契約	17,062,326	16,950,645	
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	16,819,372	17,516,929	
その他の資産	2,526,668	2,519,791	
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	73,036	74,083	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・ライツに係るもの以外のものの額	127,568	131,229	9
うち、モーゲージ・サービシング・ライツに係るものの額	-	-	20,24
資産合計	42,523,387	42,481,560	
負債			
借入金、支払債務および受入預金	11,893,312	12,036,838	
担保付調達	19,596,270	19,516,137	
トレーディング負債	7,633,279	7,528,501	
その他の負債	752,252	754,660	
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・ライツに係るもの以外のものの額に係る繰延税金負債	9,062	9,571	9
うち、モーゲージ・サービシング・ライツに係るものの額に係る繰延税金負債	-	-	20,24
負債合計	39,875,113	39,836,136	
資本			
資本金及び資本剰余金の額	1,282,937	1,284,352	1a
利益剰余金	1,554,182	1,526,834	2
累積的その他の包括利益	△65,922	△51,594	3
自己株式	△168,519	△155,659	1c
非支配持分	45,595	41,492	
資本合計	2,648,273	2,645,425	

第3章 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

		(単位:十億円、%)	
		当最終指定親会社 中間期末 (2016年9月末)	前最終指定親会社 中間期末 (2015年9月末)
連結における普通株式等Tier1資本の額	(A)	2,475.8	2,501.4
連結におけるTier1資本の額	(B)	2,566.2	2,501.4
連結における総自己資本の額	(C)	2,872.7	2,849.7
リスク・アセット	(D)=(E)+(F)+(G)	13,706.3	18,915.5
信用リスク・アセットの額の合計額	(E)	7,629.3	8,505.5
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)	3,338.5	7,558.4
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)	2,738.5	2,851.6
連結普通株式等Tier1比率	$(A)/(D) \times 100$	18.0%	13.2%
連結Tier1比率	$(B)/(D) \times 100$	18.7%	13.2%
連結総自己資本規制比率	$(C)/(D) \times 100$	20.9%	15.0%

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

(単位:十億円)

	2016年9月末		2015年9月末	
	EAD	所要自己資本額	EAD	所要自己資本額
信用リスク	22,008.2	651.0	51,286.3	922.0
内部格付手法	16,575.1	419.8	31,746.0	702.4
金融機関等向けエクスポージャー	9,149.2	63.3	12,740.8	105.9
ソブリン向けエクスポージャー	3,535.6	5.4	5,674.4	8.6
事業法人向けエクスポージャー (特定貸付債権を除く)	2,691.1	108.9	11,812.4	145.6
事業法人向けエクスポージャー (特定貸付債権)	118.1	9.7	161.6	10.9
株式等エクスポージャー	663.3	165.6	641.4	164.9
マーケット・ベース方式の簡易手法適用分	663.3	165.6	641.4	164.9
経過措置適用分	-	-	-	-
その他	360.5	47.6	638.2	240.4
信用リスク・アセットのみなし計算	57.2	19.4	77.2	26.2
標準的手法	715.2	27.4	895.7	34.8
中央清算機関関連エクスポージャー	4,717.9	25.1	18,644.6	30.9
CVAリスク	-	178.7	-	154.0
マーケット・リスク	-	267.1	-	604.7
内部モデル方式および外部格付準拠方式	-	267.1	-	604.7
オペレーショナル・リスク	-	219.1	-	228.1
粗利益配分手法	-	219.1	-	228.1
連結総所要自己資本額	-	1,096.5	-	1,513.2

- 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):標準的手法の場合は信用リスク・アセットの額×8%、内部格付手法の場合は信用リスク・アセットの額(スケーリング・ファクター1.06 勘案後)×8%+期待損失額を計算したものに相当します。
- 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 その他には、未決済取引、現金及びその他資産を含みます。
- 9 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。
- 10 標準的手法とは、内部格付手法を適用しない事業単位及び資産区分を指します。
- 11 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。
- 12 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。
- 13 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

①地域別内訳

(単位:十億円)

	2016年9月末			2015年9月末		
	デリバティブ	レポ形式の取引	その他	デリバティブ	レポ形式の取引	その他
国内	1,324.6	1,321.6	3,086.5	1,335.8	948.2	2,563.5
海外	1,924.8	7,246.8	1,613.6	2,381.5	22,137.1	2,302.6
欧州	1,166.1	1,447.6	716.6	1,469.1	3,223.7	1,284.0
北米	470.1	5,266.4	740.1	520.0	18,334.8	757.0
アジア	288.6	532.8	156.9	392.4	578.6	261.6
合計	3,249.5	8,568.4	4,700.1	3,717.3	23,085.3	4,866.2
標準的手法適用分			715.2			895.7

②業種別内訳

(単位:十億円)

	2016年9月末			2015年9月末		
	デリバティブ	レポ形式の取引	その他	デリバティブ	レポ形式の取引	その他
銀行	1,177.6	5,141.5	1,029.7	1,441.3	4,960.8	1,373.2
ブローカー/ディーラー	198.0	1,529.6	26.7	301.7	3,057.3	228.0
その他金融・保険	1,193.3	853.3	328.3	1,324.1	10,141.1	594.6
国・地方公共団体等	288.4	881.6	2,273.0	278.3	4,803.3	1,364.5
消費関連産業	80.1	0.7	35.5	79.2	0.7	49.2
その他	312.1	161.6	1,006.9	292.7	122.2	1,256.7
合計	3,249.5	8,568.4	4,700.1	3,717.3	23,085.3	4,866.2
標準的手法適用分			715.2			895.7

③残存期間別内訳

(単位:十億円)

	2016年9月末			2015年9月末		
	デリバティブ	レポ形式の取引	その他	デリバティブ	レポ形式の取引	その他
1年未満	236.8	7,479.8	184.3	377.9	21,771.6	395.8
1年以上3年未満	106.9	585.3	3,255.3	106.4	725.3	2,519.8
3年以上5年未満	99.9	308.8	9.7	101.1	404.1	58.3
5年以上	2,805.8	194.5	22.6	3,131.9	184.3	33.7
期間の定めのないもの	0.0	0.0	1,228.1	0.1	0.0	1,858.5
合計	3,249.5	8,568.4	4,700.1	3,717.3	23,085.3	4,866.2
標準的手法適用分			715.2			895.7

- 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、及び業種別また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

(単位:十億円)

リスク・ウェイト	2016年9月末	2015年9月末
	信用リスク削減手法の効果を勘案した後のエクスポージャーの額	信用リスク削減手法の効果を勘案した後のエクスポージャーの額
0%	49.8	80.9
10%	-	-
20%	33.8	22.1
35%	-	0.0
50%	6.6	9.9
100%	309.6	319.6
150%	11.6	11.1
350%	7.8	12.2
625%	-	-
937.5%	-	-
1,250%	-	-
合計	419.3	455.7

- (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

(単位:十億円)

	2016年9月末	2015年9月末
リスク・ウェイト		
50%	7.9	68.3
70%	44.4	27.4
90%	59.4	62.2
95%	-	-
115%	3.5	0.6
120%	-	-
140%	-	-
250%	1.8	3.1
0%	1.1	0.0
合計	118.1	161.6

- 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 6,633 億円のうち、リスク・ウェイト 300%適用分が 4,978 億円、同 400%適用分が 1,655 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)

(単位:十億円、%)

	2016年9月末				EAD (オン・バラン ス)	EAD (オフ・バラン ス)	コミットメント の未引出額	未引出額に 乗ずる掛目の 加重平均値
	EAD 加重 平均 PD	EAD 加重 平均 LGD	EAD 加重 平均 ELdefault	EAD 加重 平均 リスク・ウェイト				
事業法人向け	3.22%	36.79%	-	38.52%	237.1	2,454.0	0.2	75.00%
AAA~AA-	0.03%	41.33%	-	10.07%	96.5	638.3	-	-
A+~BBB-	0.15%	38.56%	-	26.26%	82.7	1,242.8	-	-
BB+~CCC	12.71%	27.62%	-	98.30%	57.4	567.8	0.2	75.00%
CC~D	100.00%	44.69%	44.69%	0.00%	0.5	5.0	-	-
金融機関等向け	0.24%	17.17%	-	7.79%	1,013.2	8,136.0	-	-
AAA~AA-	0.03%	11.03%	-	2.01%	275.0	4,228.2	-	-
A+~BBB-	0.11%	24.88%	-	12.46%	715.4	3,416.3	-	-
BB+~CCC	3.09%	9.02%	-	20.89%	22.8	491.6	-	-
CC~D	100.00%	45.00%	45.00%	0.00%	0.0	0.0	-	-
ソブリン向け	0.03%	45.40%	-	1.62%	2,272.4	1,263.2	-	-
AAA~AA-	0.00%	45.53%	-	0.30%	2,268.2	1,017.5	-	-
A+~BBB-	0.13%	43.71%	-	15.95%	4.3	240.2	-	-
BB+~CCC	15.24%	45.00%	-	154.12%	0.0	5.5	-	-
CC~D	-	-	-	-	0.0	0.0	-	-
合計	0.71%	27.10%	-	11.75%	3,522.8	11,853.2	0.2	75.00%
AAA~AA-	0.02%	26.94%	-	2.05%	2,639.7	5,884.0	-	-
A+~BBB-	0.12%	28.87%	-	15.82%	802.4	4,899.3	-	-
BB+~CCC	8.36%	19.35%	-	63.79%	80.2	1,064.9	0.2	75.00%
CC~D	100.00%	44.69%	44.69%	0.00%	0.5	5.0	-	-

(単位：十億円、%)

2015年9月末

	EAD加重 平均 PD	EAD加重 平均 LGD	EAD加重 平均 ELdefault	EAD加重 平均 リスク・ウェイト	EAD (オン・バラ ンス)	EAD (オフ・バラ ンス)	コミット メント の未引出 額	未引出額に 乗ずる掛 目の加 重平均 値
事業法人向け	1.36%	10.65%	-	11.93%	483.1	11,329.3	0.2	75.00%
AAA~AA-	0.03%	32.52%	-	8.47%	153.6	744.9	-	-
A+~BBB-	0.23%	11.05%	-	7.98%	209.7	6,280.8	-	-
BB+~CCC	3.18%	5.57%	-	18.46%	119.4	4,299.2	0.2	75.00%
CC~D	100.00%	43.68%	43.68%	0.00%	0.3	4.5	-	-
金融機関等向け	0.31%	17.85%	-	9.43%	1,536.8	11,204.0	-	-
AAA~AA-	0.03%	12.25%	-	2.56%	373.5	4,867.1	-	-
A+~BBB-	0.12%	22.72%	-	13.19%	1,125.6	5,774.4	-	-
BB+~CCC	4.98%	10.69%	-	26.14%	37.7	562.5	-	-
CC~D	-	-	-	-	-	-	-	-
ソブリン向け	0.05%	36.63%	-	1.57%	1,358.2	4,316.2	-	-
AAA~AA-	0.01%	37.84%	-	0.38%	1,353.1	3,729.4	-	-
A+~BBB-	0.10%	25.94%	-	9.18%	5.1	577.6	-	-
BB+~CCC	19.04%	45.00%	-	178.05%	0.0	9.2	-	-
CC~D	-	-	-	-	-	-	-	-
合計	0.67%	18.56%	-	8.93%	3,378.1	26,849.5	0.2	75.00%
AAA~AA-	0.02%	25.46%	-	2.04%	1,880.3	9,341.3	-	-
A+~BBB-	0.17%	17.44%	-	10.60%	1,340.4	12,632.8	-	-
BB+~CCC	3.43%	6.25%	-	19.67%	157.1	4,870.9	0.2	75.00%
CC~D	100.00%	43.68%	43.68%	0.00%	0.3	4.5	-	-

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)

(単位:十億円、%)

	2016年9月末							
	EAD加重 平均 PD	EAD加重 平均 LGD	EAD加重 平均 ELdefault	EAD加重 平均 リスク・ウェイト	EAD (オン・バラン ス)	EAD (オフ・バラン ス)	コミットメント の未引出額	未引出額に 乗ずる掛目の 加重平均値
国内	0.35%	42.98%	-	10.35%	2,250.2	2,653.9	0.2	75.00%
AAA~AA-	0.01%	45.05%	-	2.30%	2,029.0	1,372.2	-	-
A+~BBB-	0.11%	39.22%	-	19.82%	203.1	1,137.4	-	-
BB+~CCC	7.08%	30.16%	-	103.81%	17.5	140.3	0.2	75.00%
CC~D	100.00%	44.83%	44.83%	0.00%	0.5	3.9	-	-
欧州	2.23%	30.78%	-	23.00%	543.1	2,636.9	-	75.00%
AAA~AA-	0.01%	42.99%	-	4.25%	329.0	403.7	-	-
A+~BBB-	0.14%	33.29%	-	20.79%	171.5	1,509.6	-	-
BB+~CCC	8.91%	13.57%	-	45.81%	42.6	723.4	-	-
CC~D	100.00%	45.00%	45.00%	0.00%	0.0	0.3	-	-
北米	0.16%	13.28%	-	6.08%	586.6	5,740.8	-	-
AAA~AA-	0.03%	9.53%	-	1.32%	259.5	4,023.0	-	-
A+~BBB-	0.09%	20.14%	-	10.20%	319.0	1,591.1	-	-
BB+~CCC	5.43%	35.41%	-	99.31%	8.1	126.6	-	-
CC~D	100.00%	45.00%	45.00%	0.00%	0.0	0.0	-	-
アジア	1.17%	24.82%	-	18.91%	142.8	821.6	-	-
AAA~AA-	0.03%	38.23%	-	8.23%	22.2	85.1	-	-
A+~BBB-	0.19%	22.82%	-	11.91%	108.7	661.2	-	-
BB+~CCC	10.35%	25.74%	-	94.70%	11.9	74.5	-	-
CC~D	100.00%	43.83%	43.83%	0.00%	0.0	0.8	-	-
合計	0.71%	27.10%	-	11.75%	3,522.8	11,853.2	0.2	75.00%
AAA~AA-	0.02%	26.94%	-	2.05%	2,639.7	5,884.0	-	-
A+~BBB-	0.12%	28.87%	-	15.82%	802.4	4,899.3	-	-
BB+~CCC	8.36%	19.35%	-	63.79%	80.2	1,064.9	0.2	75.00%
CC~D	100.00%	44.69%	44.69%	0.00%	0.5	5.0	-	-

(単位:十億円、%)

	2015年9月末							
	EAD加重 平均 PD	EAD加重 平均 LGD	EAD加重 平均 ELdefault	EAD加重 平均 リスク・ウェイト	EAD (オン・バラン ス)	EAD (オフ・バラン ス)	コミットメント の未引出額	未引出額に 乗ずる掛目の 加重平均値
国内	0.75%	40.62%	-	15.53%	1,436.2	2,293.4	0.2	75.00%
AAA~AA-	0.01%	43.05%	-	3.21%	1,160.3	943.3	-	-
A+~BBB-	0.13%	38.52%	-	24.97%	257.1	1,216.9	-	-
BB+~CCC	14.52%	26.83%	-	97.44%	18.6	128.9	0.2	75.00%
CC~D	100.00%	45.00%	45.00%	0.00%	0.1	4.3	-	-
欧州	1.10%	36.34%	-	21.40%	1,025.5	4,727.8	0.0	75.00%
AAA~AA-	0.01%	44.66%	-	3.30%	349.0	1,671.5	-	-
A+~BBB-	0.14%	34.87%	-	23.76%	597.5	2,430.5	-	-
BB+~CCC	8.30%	18.83%	-	63.21%	78.8	625.7	0.0	75.00%
CC~D	100.00%	28.52%	-	0.00%	0.2	0.2	-	-
北米	0.48%	8.55%	-	2.91%	675.5	18,857.3	-	-
AAA~AA-	0.02%	14.30%	-	1.18%	316.4	6,625.9	-	-
A+~BBB-	0.19%	6.79%	-	2.95%	325.0	8,247.0	-	-
BB+~CCC	1.88%	2.39%	-	5.80%	34.2	3,984.4	-	-
CC~D	-	-	-	-	-	-	-	-
アジア	1.52%	27.53%	-	26.50%	240.9	971.0	-	-
AAA~AA-	0.03%	36.94%	-	8.54%	54.6	100.7	-	-

A+～BBB-	0.15%	25.60%	-	15.67%	160.8	738.4	-	-
BB+～CCC	10.78%	29.31%	-	106.02%	25.5	131.9	-	-
CC～D	100.00%	45.00%	45.00%	0.00%	-	0.0	-	-
合計	0.67%	18.56%	-	8.93%	3,378.1	26,849.5	0.2	75.00%
AAA～AA-	0.02%	25.46%	-	2.04%	1,880.3	9,341.3	-	-
A+～BBB-	0.17%	17.44%	-	10.60%	1,340.4	12,632.8	-	-
BB+～CCC	3.43%	6.25%	-	19.67%	157.1	4,870.9	0.2	75.00%
CC～D	100.00%	43.68%	43.68%	0.00%	0.3	4.5	-	-

- 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_{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また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おります。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)、またはポジション解消(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となっております。

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

(単位:十億円)

	2016年9月末			クレジット・ デリバティブ
	金融資産担保	資産担保	保証	
内部格付手法	6,180.6	-	-	-
金融機関等向けエクスポージャー	5,664.0	-	-	-
ソブリン向けエクスポージャー	29.6	-	-	-
事業法人向けエクスポージャー	487.0	-	-	-

(単位:十億円)

	2015年9月末			クレジット・ デリバティブ
	金融資産担保	資産担保	保証	
内部格付手法	17,773.9	-	-	-
金融機関等向けエクスポージャー	7,700.0	-	-	-
ソブリン向けエクスポージャー	1,055.7	-	-	-
事業法人向けエクスポージャー	9,018.1	-	-	-

- 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

(単位:十億円)

		2016年9月末		
		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)	2,707.8	2,885.5	5,593.2
外国為替関連取引および金関連取引		64.4	68.4	132.9
金利関連取引		2,090.0	865.9	2,955.9
株式関連取引		524.0	1,860.9	2,384.9
貴金属関連取引(金を除く)		0.0	0.2	0.2
その他のコモディティ関連取引		22.7	57.9	80.7
クレジット・デリバティブ取引		6.6	32.2	38.8
長期決済期間取引	(B)	0.0	0.0	0.0
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)	-	-	3,764.6
ネットの与信相当額	(D)=(A)+(B)-(C)	-	-	1,828.7
担保の額	(E)	-	-	144.4
金融資産担保		-	-	144.4
与信相当額(担保勘案後)	(D)-(E)			1,684.3

(単位:十億円)

2015年9月末

		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)	1,472.6	2,827.2	4,299.8
外国為替関連取引および金関連取引		145.7	100.9	246.6
金利関連取引		241.1	135.0	376.1
株式関連取引		1,047.8	2,495.3	3,543.2
貴金属関連取引(金を除く)		0.2	0.6	0.8
その他のコモディティ関連取引		12.8	48.0	60.8
クレジット・デリバティブ取引		24.9	47.4	72.3
長期決済期間取引	(B)	5.6	0.0	5.6
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)	-	-	2,493.9
ネットの与信相当額	(D)=(A)+(B)-(C)	-	-	1,811.5
担保の額	(E)	-	-	213.4
金融資産担保		-	-	213.4
与信相当額(担保勘案後)	(D)-(E)			1,598.1

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または提供の別に区分した額

(単位:十億円)

	2016年9月末		2015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)	12,700.5	12,583.4	17,744.4	17,061.8
クレジット・デフォルト・スワップ(指数)	4,728.5	4,751.8	6,224.4	6,627.5
その他のクレジット・リスク関連ポートフォリオ商品	300.1	374.1	526.9	478.0
クレジット・リスク関連オプションおよびスワプション	3.0	0.8	94.8	102.2
合計	17,732.2	17,710.0	24,590.6	24,269.6

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

(単位:十億円)

	2016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)
RMBS	49.2	1.4	25.3
CMBS	15.7	-	4.8
CDO/CLO	62.0	0.9	31.5
Consumer	1.5	-	-
Commercial	0.5	0.0	0.5
その他	1.0	-	0.4
合計	130.0	2.2	62.7

(単位:十億円)

	2015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)
RMBS	188.4	21.0	100.7
CMBS	206.8	0.5	20.0
CDO/CLO	75.6	0.0	32.9
Consumer	57.8	-	1.7
Commercial	2.0	-	0.0
その他	47.8	0.0	18.2
合計	578.5	21.4	173.5

- (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

(単位:十億円)

	2016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)	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	18.0	-	0.2	-
1.6%超 4%以下	18.9	-	0.5	-
4%超 8%以下	14.0	0.0	0.8	0.0
8%超 20%以下	2.4	-	0.5	-
20%超 100%未満	14.1	-	5.4	-
100%	62.7	2.2	58.9	2.2
合計	130.0	2.2	66.2	2.2

(単位:十億円)

	2015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)	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	215.8	-	1.4	-
1.6%超 4%以下	82.3	0.6	1.7	0.0
4%超 8%以下	33.9	-	1.8	-
8%超 20%以下	48.5	1.5	4.4	0.2
20%超 100%未満	24.5	0.1	10.4	0.1
100%	173.5	19.2	157.9	19.2
合計	578.5	21.4	177.5	19.5

(注) 2013年12月末以降はロング及びショート・ポジションをグロス合計し、エクスポージャーの額及び所要自己資本の額を算出しております。

- (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

(単位:十億円)

	2016年9月末	2015年9月末
エクスポージャーの総額		
ヘッジ込み	130.2	74.0
ヘッジ除外	76.8	57.2

(単位:十億円)

	2016年9月末	2015年9月末
所要自己資本		
デフォルト	1.1	0.4
相関	0.0	0.0
クレジット・スプレッド	2.0	3.0
その他	△0.5	0.3
包括的リスクの額	2.6	3.6

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

(単位:十億円)

	2016年4月1日～2016年9月30日				2015年4月1日～2015年9月30日			
	日次平均	最高	最低	2016年 9月末	日次平均	最高	最低	2015年 9月末
VaR(10day)	16.7	23.2	11.1	16.4	24.8	36.7	16.5	26.2

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

(単位:十億円)

	2016年4月1日～2016年9月30日				2015年4月1日～2015年9月30日			
	日次平均	最高	最低	2016年 9月末	日次平均	最高	最低	2015年 9月末
ストレスVaR	31.1	47.0	19.3	28.8	67.7	111.0	44.2	70.4

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

(単位:十億円)

	2016年4月1日～2016年9月30日				2015年4月1日～2015年9月30日			
	日次平均	最高	最低	2016年 9月末	日次平均	最高	最低	2015年 9月末
追加的リスク	82.4	99.9	70.5	73.1	129.0	155.4	107.8	117.5
包括的リスク	4.2	4.6	3.8	4.4	11.9	18.8	9.6	9.6

(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

2015年10月1日から2016年9月30日までの期間において、グループ・レベルでバックテストの超過はありません。

9. トレーディング業務以外の出資等また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

(単位:十億円)

	2016年9月末		2015年9月末	
	連結貸借対照表 計上額	時価	連結貸借対照表 計上額	時価
経過措置適用分	-	-	-	-
上場株式等エクスポージャー	497.5	546.3	568.8	760.6
上記以外の株式等エクスポージャー	165.8	165.8	72.5	72.5
合計	663.3	712.1	641.4	833.2

(2) 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

(単位:十億円)

	2016年9月末	2015年9月末
PD/LGD方式	-	-
マーケット・ベース方式の簡易手法適用分	663.3	641.4
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	-	-
合計	663.3	641.4

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また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章 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	2022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	2022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）	
	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）	株主資本
	連結貸借対照表	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）	
	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	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）	永久劣後債務
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回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約及び劣後特約付適格機関投資家限定)

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	JP376260AGD1
3	準拠法	日本法
	規制上の取扱い (1)	
4	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 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	第1回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約及び劣後特約付・適格機関投資家限定)
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	165,000 百万円
9	額面総額 (4)	165,000 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)	2016年1月27日
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	有
	初回償還可能日及びその償還金額 (7)	初回償還可能日:2021年6月15日 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)	2021年6月15日以降の各利払日 (本社債の元金につき損失吸収事由に係る債務免除がなされている場合を除く。)、又は税務事由若しくは資本事由 (発行者が金融庁その他の監督当局と協議した結果、金融庁その他の監督当局が定める自己資本規制比率基準に照らして、本社債が発行者のその他 Tier1 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) が発生した場合において、任意償還可能
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)	2021年6月15日以降の各利払日
	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)	固定から変動
18	配当率又は利率 (11)	2016年1月28日から2021年6月15日まで: 年3.36パーセント 2021年6月15日の翌日以降: 6か月物ユーロ円 LIBOR + 3.20パーセント
19	配当等停止条項の有無 (12)	有
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)	完全裁量
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)	(i) 損失吸収事由:発行者が報告又は公表した連結普通株式等 Tier1 比率が 5.125%を下回った場合 (ii) 実質破綻事由:内閣総理大臣が、発行者について、預金保険法に定める特定第二号措置を講ずる必要がある旨の特定認定を行った場合 (iii) 倒産手続開始事由:発行者につき倒産手続開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲 (20)	全部削減または一部削減
33	元本回復特約の有無 (21)	有
34	その概要	元金回復がなされた後においても、十分に高い水準の連結普通株式等 Tier1 比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、発行者が元金の支払債務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合
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)	劣後債務 (本社債および本社債と実質的に同順位の劣後債務を除く)
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。

利払停止特約の概要

(1) 任意利払停止

発行者は、本社債の利息の支払を行わないことが必要であると其の完全な裁量により判断する場合には、各利払日において、本社債の利息の全部又は一部の支払を行わないことができる。この場合、発行者は、その次の利払日に支払うべき本社債の利息の支払又は不支払を決定するまでの期間中、(i) 発行者の普通株式及びその他 Tier1 資本調達手段に該当する発行者の株式(配当最優先株式を除く。)に対する金銭の配当並びに(ii) その他 Tier1 資本調達手段に該当する配当最優先株式に対する優先配当金の額の半額に、当該利払日に支払うべき本社債の利息のうち支払を行う部分として発行者が決定した割合を乗じた額を超える額の金銭の配当を行う旨の取締役会の決議又はかかる配当を行う旨の会社提案の議案の株主総会への提出等を行わない。

(2) 利払可能額制限

発行者が各利払日に支払うべき本社債の利息の額は、利払可能額を限度とし、発行者は当該限度額を超える金額について、本社債の利息の支払を行わない。「利払可能額」とは、ある利払日における発行者の会社法上の分配可能額から、当該利払日の属する事業年度の初日以後当該利払日の前日までに支払われた本社債、同順位証券及び劣後証券の配当及び利息の総額を控除して得られる調整後分配可能額を、当該利払日に支払うべき本社債の利息の総額並びに配当最優先株式及び同順位証券の配当又は利息の総額で按分して算出される額のうち、各本社債に係る按分額をいう。

「同順位証券」とは、発行者の債務で、利息に係る権利について本社債と実質的に同じ条件を付されたもの等をいう。

「劣後証券」とは、発行者の債務で、利息に係る権利について本社債に実質的に劣後する条件を付されたもの等をいう。

上記(1)又は(2)に基づき支払われなかった本社債の利息は繰り延べられず、当該利息の支払債務の効力は将来に向かって消滅する。

債務免除特約の概要

(1) 損失吸収事由に係る債務免除

発行者が報告又は公表した連結普通株式等 Tier1 比率が5.125%を下回った場合、本社債の元金のうち、本社債及び他の負債性その他 Tier1 資本調達手段等の全部又は一部の免除又は普通株式転換により発行者の連結普通株式等 Tier1 比率が 5.125%を上回ることとなるために必要な額として、発行者が金融庁その他の監督当局と協議の上決定する額を、本社債の元金の総額及び他の負債性その他 Tier1 資本調達手段等の元金の総額で按分して算出される額のうち、各本社債に係る按分額、並びに当該金額の元金に応じた利息について、発行者は本社債に基づく元利金の支払債務を免除される。

(2) 実質破綻事由に係る債務免除

発行者について預金保険法に定める特定第二号措置を講ずる必要がある旨の特定認定が行われた場合、発行者は、本社債に基づく元利金の支払債務の全額を免除される。

(3) 倒産手続開始事由に係る債務免除

発行者について、倒産手続の開始の決定等が行われた場合、発行者は、本社債に基づく元利金の支払債務の全額を免除される。

元金回復特約の概要

損失吸収事由の発生により、本社債に基づく元金の一部の支払債務が免除されている場合において、元金回復事由が生じた場合、発行者が金融庁その他の監督当局との協議のうえ決定する額について、支払債務の免除の効力は将来に向かって消滅する。「元金回復事由」とは、元金回復がなされた直後においても、十分に高い水準の連結普通株式等 Tier1 比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、発行者が元金の支払債務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定した場合をいう。

劣後特約の概要

本社債は、発行者の清算手続(特別清算手続を除く。)における債務の支払に関し、実質的に、発行者の一般債権者及び期限付劣後債権者に劣後し、普通株式に優先し、残余財産分配最優先株式と同順位となる。

3. 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	2022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	2022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	153,879 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）	2011年12月26日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2021年12月24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:2016年12月26日 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）	特別早期償還特約の対象となる事由: 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。） 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）	2011年12月27日から2016年12月26日まで: 年2.24パーセント 2016年12月26日の翌日以降: 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： 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 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、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、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、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。

(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)発行者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	2022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	2022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）	2011年12月26日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2021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:2016年12月26日 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: 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。） 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）	2011年12月27日から2016年12月26日まで: 年2.24パーセント 2016年12月26日の翌日以降: 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： 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 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、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受けたこと。

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。

(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)発行者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	2022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	2022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)	
	連結自己資本規制比率	23,700 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)	負債
	連結貸借対照表	負債
11	発行日(6)	2010年11月26日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2025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)	
	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)	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

■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、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。

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。

(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) 発行者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	2022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	2022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	34,020 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)	2010年11月26日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2025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:2020年11月26日 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)	2020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、最も劣後の内容をもつもの名称又は種類(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、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。

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。

(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) 発行者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	2022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	2022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	3,600百万円
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)	2010年11月26日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2025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:2020年11月26日 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)	2020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)	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)	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、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。

(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) 発行者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	2022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	2022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	30,000 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)	2010年12月6日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2025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:2020年11月26日 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)	2020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、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。

(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) 発行者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。

9. 野村証券株式会社 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	野村証券株式会社
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	2022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	2022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	野村証券株式会社第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	14,604 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)	2008年3月26日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2018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。

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。

10. 野村証券株式会社 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	野村証券株式会社
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	2022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	2022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	34,666 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)	2008年6月25日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2018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) 2016年3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。

11. 野村証券株式会社 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	野村証券株式会社
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	2022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	2022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	3,488 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)	2008年6月30日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2018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) 2016年3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。

12. キャピタル・ノムラ・セキュリティーズ・パブリック CO., LTD 非支配持分

自己資本調達手段(非支配持分)

1	発行者	キャピタル・ノムラ・セキュリティーズ・パブリック CO., LTD.
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	TH0108010Z01
3	準拠法	タイ法
	規制上の取扱い (1)	
4	2022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 その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 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	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)	
	連結自己資本規制比率	1,114 百万円
9	額面総額 (4)	
10	表示される科目の区分 (5)	非支配持分
	連結貸借対照表	非支配持分
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)	
	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)	
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	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)	

13. Nomura Asset Management Taiwan Ltd. 非支配持分

自己資本調達手段(非支配持分)

1	発行者	Nomura Asset Management Taiwan Ltd.
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	
3	準拠法	香港法
	規制上の取扱い(1)	
4	2022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 その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 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	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)	
	連結自己資本規制比率	1,166百万円
9	額面総額(4)	
10	表示される科目の区分(5)	非支配持分
	連結貸借対照表	非支配持分
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)	
	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	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)	

14. Nomura Asia Investment (Viet Nam) Pte Ltd 非支配持分

自己資本調達手段（非支配持分）

1	発行者	Nomura Asia Investment (Viet Nam) Pte Ltd
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	
3	準拠法	シンガポール法
	規制上の取扱い(1)	
4	2022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 その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 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	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)	
	連結自己資本規制比率	155 百万円
9	額面総額(4)	
10	表示される科目の区分(5)	非支配持分
	連結貸借対照表	非支配持分
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)	
	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	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)	

15. Chi-X Global Holdings LLC 非支配持分

自己資本調達手段(非支配持分)

1	発行者	Chi-X Global Holdings LLC
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	
3	準拠法	デラウェア州法
	規制上の取扱い(1)	
4	2022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 その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 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	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)	
	連結自己資本規制比率	313 百万円
9	額面総額(4)	
10	表示される科目の区分(5)	非支配持分
	連結貸借対照表	非支配持分
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)	
	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	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)	

16. 株式会社杉村倉庫 非支配持分

自己資本調達手段(非支配持分)

1	発行者	株式会社杉村倉庫
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	
3	準拠法	日本法
	規制上の取扱い(1)	
4	2022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 その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 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	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)	
	連結自己資本規制比率	1,288 百万円
9	額面総額(4)	
10	表示される科目の区分(5)	非支配持分
	連結貸借対照表	非支配持分
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)	
	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	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)	

17. Shanghai Nomura Lujiazui Investment Management Co., Ltd. 非支配持分

自己資本調達手段(非支配持分)

1	発行者	Shanghai Nomura Lujiazui Investment Management Co., Ltd.
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	
3	準拠法	中華人民共和国公司法
	規制上の取扱い(1)	
4	2022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 その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 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	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)	
	連結自己資本規制比率	100 百万円
9	額面総額(4)	
10	表示される科目の区分(5)	非支配持分
	連結貸借対照表	非支配持分
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)	
	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	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)	

18. 株式会社ウエルス・スクエア 非支配持分

自己資本調達手段（非支配持分）

1	発行者	株式会社ウエルス・スクエア
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	
3	準拠法	日本法
	規制上の取扱い(1)	
4	2022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 その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022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	その他 Tier1 資本に係る基礎項目の額 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	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)	
	連結自己資本規制比率	184百万円
9	額面総額(4)	
10	表示される科目の区分(5)	非支配持分
	連結貸借対照表	非支配持分
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)	
	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	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)	

第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項

(単位:百万円、%)

国際様式(表2)の該当番号	国際様式(表1)の該当番号	項目	2016年9月末	2015年9月末
			当最終指定親会社 中間期末	前最終指定親会社 中間期末
オン・バランス資産の額(1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	23,201,276	23,953,011
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	42,957,438	43,960,331
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△) (注1)	400,290	400,652
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子法人の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	—	—
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	19,355,871	19,606,669
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	191,375	196,273
3		オン・バランス資産の額 (イ)	23,009,901	23,756,738
デリバティブ取引等に関する額(2)				
4		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	2,175,441	2,715,214
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	9,599,593	11,623,120
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	764,767	730,058
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	1,815,148	1,701,117
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	648,749	894,999
8		清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)		
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	17,453,571	23,992,733
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	15,470,225	21,033,056
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	15,689,547	18,834,186
レポ取引等に関する額(3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	33,625,288	35,982,481
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	16,558,947	18,796,659
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	1,587,977	2,548,711
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	18,654,318	19,734,532
オフ・バランス取引に関する額(4)				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	1,501,403	1,123,320
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	488,534	339,714
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	1,012,869	783,606
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	2,566,248	2,501,414
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	58,366,635	63,109,063
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.39%	3.96%

(注) 1 「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第三条第一項の規定に基づき、金融庁長官が別に定める連結レバレッジ比率」(平成二十七年金融庁告示第十一号)第3条第3項に基づき、連結保険子法人等について、連結レバレッジ比率算出において、非連結子会社としての取り扱いをしております。

第2部 連結流動性規制に関する開示

(流動性に係る経営の健全性の状況)

金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が流動性に係る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 27 年金融庁告示第 9 号)に基づき行う開示

第1章 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位:百万円、%、件)

項目		当最終指定親会社四半期 (2017年3月期 第2 四半期)		前最終指定親会社四半期 (2017年3月期 第1四半期)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	5,168,016		5,816,876	
資金流出額 (2)					
		資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額	資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	422,034	88,001	435,135	98,802
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	422,034	88,001	435,135	98,802
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,550,731	1,402,416	1,824,656	1,689,429
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	1,251,331	1,103,015	1,563,805	1,428,577
8	うち、負債性有価証券の額	299,400	299,400	260,852	260,852
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	2,749,017		2,737,499	
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	2,250,296	2,037,057	2,082,703	1,858,381
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,943,921	1,943,921	1,737,926	1,737,926
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	-	-	-	-
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	306,375	93,137	344,777	120,455
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,480,947	1,047,865	4,486,484	1,090,416
15	偶発事象に係る資金流出額	496,792	224,547	501,285	242,188
16	資金流出合計額	7,548,902		7,716,716	
資金流入額 (3)					
		資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額	資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	27,440,848	1,922,865	26,717,479	2,022,781
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	793,137	723,884	789,158	711,091
19	その他資金流入額	5,159,110	2,056,730	4,488,206	1,929,629
20	資金流入合計額	33,393,095	4,703,478	31,994,843	4,663,501
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額	5,168,016		5,816,876	
22	純資金流出額	2,845,424		3,053,215	
23	連結流動性カバレッジ比率	181.3%		190.8%	
24	平均値計算用データ数	3		3	

第2章 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

1. 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当グループの第2四半期連結会計期間の月次平均適格流動資産の合計額は前四半期比6,488億60百万円減の5兆1,680億16百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同2,870億13百万円減の1兆4,024億16百万円、デリバティブ取引等に係る資金流出額に係る資金流出額が同2,059億94百万円減の1兆9,439億21百万円、その他資金流入額(主にデリバティブ取引等に係る資金流入)が同1,271億1百万円増の2兆567億30百万円、純資金流出額は同2,077億91百万円減の2兆8,454億24百万円となりました。

この結果、連結流動性カバレッジ比率の第2四半期連結会計期間の月次平均は、同9.5%減の181.3%となりました。

当グループの連結流動性カバレッジ比率が変動する主な要因としては、顧客とのデリバティブ取引及び有価証券売買取引に伴うトレーディング在庫の変動に伴う資金流出入金額の変化が挙げられます。

2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当グループの第2四半期連結会計期間の月次平均連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低要求水準を十分に上回っております。

また、当グループでは、連結流動性カバレッジ比率に関するリスク・アピタイトを定め、同比率が法令上の最低要求水準を上回る水準であることを日次で確認しております。

3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産の内容について著しい変動はありませんでした。

4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

該当する重要な事項はございません。