

2018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	2018年4月1日
(第115期)	至	2018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	4
第1章 自己資本の構成に関する開示事項（四半期）	5
第2章 自己資本の構成に関する開示事項（中間）	10
第3章 定性的な開示事項.....	16
1. 連結の範囲	16
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.....	17
第4章 定量的な開示事項（当期末分）	18
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	18
2. 信用リスクに関する次に掲げる事項.....	18
3. 第三の柱に関する告示別紙様式第4号、6号および7号に基づく開示事項.....	19
第5章 定量的な開示事項（前中間期末分）	36
1. 連結自己資本規制比率に関する事項.....	36
2. 自己資本の充実度に関する事項.....	36
3. 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	37
4. 信用リスク削減手法に関する事項.....	42
5. 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.....	42
6. 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.....	43
7. マーケット・リスクに関する事項.....	44
8. 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	45
第6章 自己資本調達手段に関する契約内容	46
1. 野村ホールディングス株式会社 普通株式.....	46
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）	48
3. 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）	51
4. 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）	55
5. 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）	59
6. 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）	63
7. 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	67
8. Nomura Asset Management Taiwan Ltd. 非支配持分.....	69
9. Chi-X Global Holdings LLC 非支配持分.....	71
10. 株式会社杉村倉庫 非支配持分.....	73
11. Shanghai Nomura Lujiazui Investment Management Co., Ltd. 非支配持分.....	75
12. 株式会社ウエルス・スクエア 非支配持分.....	77
13. エイト証券株式会社 非支配持分.....	79
第7章 連結レバレッジ比率に関する開示事項（四半期）	81
第8章 連結レバレッジ比率に関する開示事項（中間）	83

第2部 連結流動性規制に関する開示	85
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	86
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	87
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	87
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	87
3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項	87
4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項	87
第3部 開示方針	88

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、最終指定親会社が自己資本の充実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（四半期）

（単位：百万円、％）

国際様式の該当番号	項目	2018年9月末	2018年6月末
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	2,792,044	2,817,501
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	1,275,551	1,270,805
2	うち、利益剰余金の額	1,679,085	1,700,809
1c	うち、自己株式の額（△）	162,591	154,113
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	6,373	△22,546
5	普通株式等Tier1 資本に係る調整後非支配株主持分の額	11	10
6	普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目（イ）の額	2,798,429	2,794,965
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	194,513	193,730
8	うち、のれんに係るもの（のれん相当差額を含む。）の額	83,643	81,728
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	110,869	112,002
10	繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）の額	1,672	2,106
11	繰延ヘッジ損益の額	—	—
12	適格引当金不足額	25,908	26,265
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	9,368	9,705
15	前払年金費用の額	10,648	10,483
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	8,512	7,767
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	—	—

(単位：百万円、%)

国際様式の該当番号	項目	2018年9月末	2018年6月末
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	—	—
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)	250,624	250,060
普通株式等Tier1 資本			
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)－(ロ)) (ハ)	2,547,804	2,544,904
その他Tier1 資本に係る基礎項目(3)			
30	31a	その他Tier1 資本調達手段に係る株主資本の額	—
	31b	その他Tier1 資本調達手段に係る新株予約権の額	—
	32	その他Tier1 資本調達手段に係る負債の額	165,000
		特別目的会社等の発行するその他Tier1 資本調達手段の額	—
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		1,071
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		—
36	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 (ニ)		166,071

(単位：百万円、%)

国際様式の該当番号	項目	2018年9月末	2018年6月末
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	—	—
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	—	—
42	Tier2 資本不足額	—	—
43	その他Tier1 資本に係る調整項目の額 (ホ)	—	—
その他Tier1 資本			
44	その他Tier1 資本の額((二)－(ホ)) (ヘ)	166,071	166,027
Tier1 資本			
45	Tier1 資本の額((ハ)＋(ヘ)) (ト)	2,713,876	2,710,931
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	—	—
	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	254	244
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	60,880	60,880
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	60,880	60,880
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	—	—
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	—	—
51	Tier2 資本に係る基礎項目の額 (チ)	61,134	61,124

(単位：百万円、%)

国際様式の該当番号	項目	2018年9月末	2018年6月末
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	—	—
57	Tier2 資本に係る調整項目の額 (リ)	—	—
Tier2 資本			
58	Tier2 資本の額((チ)－(リ)) (ヌ)	61,134	61,124
総自己資本			
59	総自己資本合計((ト)＋(ヌ)) (ル)	2,775,010	2,772,055
リスク・アセット(5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	14,981,255	15,801,376
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)／(ヲ))	17.00%	16.10%
62	連結Tier1 比率((ト)／(ヲ))	18.11%	17.15%
63	連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))	18.52%	17.54%
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	130,147	119,164
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	193,890	187,702
74	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	4,496	6,407
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	—	—

(単位：百万円、%)

国際様式の該当番号	項目	2018年9月末	2018年6月末
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	60,880	60,880
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。）	92,220	92,320

第2章 自己資本の構成に関する開示事項（中間）

（単位：百万円、％）

国際様式の該当 番号	項目	2018年9月末	2017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	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	2,792,044	2,781,236	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の 額	1,275,551	1,271,939	
2	うち、利益剰余金の額	1,679,085	1,717,475	
1c	うち、自己株式の額（△）	162,591	208,179	
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	6,373	11,333	2,833
5	普通株式等Tier1 資本に係る調整 後非支配株主持分の額	11	—	
	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	—	1,532	
6	普通株式等Tier1 資本に係 る基礎項目の額（イ）	2,798,429	2,794,101	
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	194,513	156,727	39,182
8	うち、のれんに係るもの（のれ ん相当差額を含む。）の額	83,643	66,836	16,709
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	110,869	89,891	22,473
10	繰延税金資産（一時差異に係るも のを除く。）の額	1,672	4,758	1,189
11	繰延ヘッジ損益の額	—	—	—
12	適格引当金不足額	25,908	21,748	5,437
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	9,368	1,970	492
15	前払年金費用の額	10,648	8,722	2,180
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	8,512	1,477	369

(単位：百万円、%)

国際様式の該当 番号	項目	2018年9月末	2017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	経過措置による 不算入額
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	—	—	—
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)	250,624	195,401	
普通株式等Tier1 資本				
29	普通株式等Tier1 資本の額 (ハ) ((イ)－(ロ))	2,547,804	2,598,700	
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		その他Tier1 資本調達手段に係る 新株予約権の額	—	—
32		その他Tier1 資本調達手段に係る 負債の額	165,000	165,000
		特別目的会社等の発行するその他 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	2018年9月末	2017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	経過措置による 不算入額
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	1,071	1,285	
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	—	2,833	
	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	—	2,833	
36	その他Tier1 資本に係る基 礎項目の額 (二)	166,071	169,118	
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	—	—	—
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	—	4,001	1,000
	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	—	23,341	
	うち、無形固定資産（のれんに 係るものに限る）の額	—	16,709	
	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	—	3,421	
	うち、期待損失額の対適格引当 金超過額を2で除した額	—	2,718	
	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	—	492	
42	Tier2 資本不足額	—	—	
43	その他Tier1 資本に係る調 整項目の額 (ホ)	—	27,342	

(単位：百万円、%)

国際様式の該当 番号	項目	2018年9月末	2017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	経過措置による 不算入額
その他Tier1 資本				
44	その他Tier1 資本の額((ニ) －(ホ)) (ヘ)	166, 071	141, 776	
Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額((ハ)＋ (ヘ)) (ト)	2, 713, 876	2, 740, 476	
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	—	—	
	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	254	302	
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	60, 880	97, 036	
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	60, 880	76, 100	
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	—	20, 936	
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	—	—	
	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 (チ)の額	61, 134	97, 338	
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	—	—	—

(単位：百万円、%)

国際様式の該当 番号	項目	2018年9月末	2017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	経過措置による 不算入額
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	—	266	67
	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	—	3,785	
	うち、他の金融機関等の資本調 達手段の額	—	1,067	
	うち、期待損失額の対適格引当 金超過額を2で除した額	—	2,718	
57	Tier2 資本に係る調整項目 (リ) の額	—	4,052	
Tier2 資本				
58	Tier2 資本の額((チ)ー (ヌ) (リ))	61,134	93,286	
総自己資本				
59	総自己資本合計((ト)+(ヌ)) (ル)	2,775,010	2,833,762	
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	—	22,791	
	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	—	19,052	
	うち、繰延税金資産(一時差異 に係るものを除く)の額	—	1,189	
	うち、前払年金費用の額	—	2,180	
	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	—	369	
60	リスク・アセットの額の合計 (ヲ) 額	14,981,255	14,867,784	
連結自己資本規制比率				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ) /(ヲ))	17.00%	17.4%	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	18.11%	18.4%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/ (ヲ))	18.52%	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	130,147	129,427	

(単位：百万円、%)

国際様式の該当 番号	項目	2018年9月末	2017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	経過措置による 不算入額
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	193,890	197,355	
74	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	4,496	29,998	
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 ージャー及びブリテール向けエク 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	60,880	155,660	
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。）	92,220	76,000	

第3章 定性的な開示事項

1. 連結の範囲

- (1) 「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12月金融庁告示第130号。以下、「連結自己資本規制比率告示」といいます。）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、「会社グループ」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、会社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、同じく会社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

2018年9月末において、野村證券株式会社（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189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
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については、該当ありません。

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については、2018年9月末において、

Nomura Reinsurance ICC Limited	（ガーンジー、保険業、総資産0.6億円、純資産0.5億円）、
Nomura Reinsurance 1 IC Limited	（ガーンジー、保険業、総資産259億円、純資産16億円）、
Nomura Reinsurance 3 IC Limited	（ガーンジー、保険業、総資産3億円、純資産3億円）、
Nomura Reinsurance 5IC Limited	（ガーンジー、保険業、総資産27億円、純資産8億円）、
US CB Reinsurance 1 IC Limited	（ガーンジー、保険業、総資産14億円、純資産12億円）、
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43億円、純資産40億円）、
Nomura Americas US Re Ltd.	（バミューダ、保険業、総資産18億円、純資産16億円）、

その他VIE1,050社が該当します。

- (5) 会社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

会社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)
	2018年9月末	2018年6月末	
資産			
現金・預金	3,456,765	3,052,104	
貸付金および受取債権	3,582,849	3,478,675	
担保付契約	19,922,454	17,397,776	
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	16,077,721	16,572,847	
その他の資産	2,292,034	2,299,733	
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	83,644	81,728	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	117,916	118,951	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	45,331,824	42,801,135	
負債			
借入金、支払債務および受入預金	12,598,783	12,497,543	
担保付調達	20,437,386	18,459,812	
トレーディング負債	8,600,314	8,246,226	
その他の負債	851,691	754,626	
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	7,046	6,948	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	42,488,174	39,958,207	
資本			
資本金及び資本剰余金の額	1,275,551	1,270,805	1a
利益剰余金	1,679,084	1,700,809	2
累積的その他の包括利益	6,373	△22,547	3
自己株式	△162,592	△154,114	1c
非支配持分	45,233	47,974	
資本合計	2,843,650	2,842,928	

(注)

連結貸借対照表の科目が「第1章 自己資本の構成に関する開示事項」に記載する項目のいずれに相当するかについて、当計表の「第1章の対応項目（国際様式の該当項目）」欄をご参照ください。

第4章 定量的な開示事項（当期末分）

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（連結自己資本規制比率告示第8条第8項第1号に規定するその他金融機関等をいう。）であって最終指定親会社の子法人等であるもののうち、連結自己資本規制比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称および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. 信用リスクに関する次に掲げる事項

標準的手法において複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないものの額及び内部格付手法において信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーの額

（単位：百万円）

	エクスポージャーの額
標準的手法において複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないものの額	4,174
内部格付手法において信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーの額	43,070

3. 第三の柱に関する告示別紙様式第4号、6号および7号に基づく開示事項

「金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が自己資本の充実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。以下、「第三の柱に関する告示」といいます。）における別紙様式第4号、6号および7号に基づき求められる開示事項は以下のとおりです。

(1) 主要な指標

KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

KM 1：主要な指標						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2018年 9 月末	2018年 6 月末	2018年 3 月末	2017年12月末	2017年 9 月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,547,804	2,544,904	2,499,965	2,605,378	2,598,699
2	Tier1資本の額	2,713,876	2,710,931	2,666,366	2,742,365	2,740,475
3	総自己資本の額	2,775,010	2,772,055	2,732,452	2,827,445	2,833,762
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	14,981,255	15,801,376	15,122,291	15,009,955	14,867,783
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	17.00%	16.10%	16.53%	17.3%	17.4%
6	連結Tier1比率	18.11%	17.15%	17.63%	18.2%	18.4%
7	連結総自己資本比率	18.52%	17.54%	18.06%	18.8%	19.0%
資本バッファ						
8	資本保全バッファ比率	1.87%	1.87%	1.87%	1.25%	1.25%
9	カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.04%	0.04%	0.02%	0.00%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッファ比率	0.37%	0.37%	0.37%	0.25%	0.25%
11	最低連結資本バッファ比率	2.29%	2.29%	2.27%	1.50%	1.50%
12	連結資本バッファ比率	10.52%	9.54%	10.06%	10.83%	11.05%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	60,981,569	58,967,416	56,135,086	61,061,858	59,859,050
14	連結レバレッジ比率	4.45%	4.59%	4.74%	4.49%	4.57%

(注)

2017年12月末以前（ニ欄およびホ欄）の自己資本比率については、小数点第一位未満を切り捨て表示しております。

(単位：百万円、%)

（単位：百万円、％）

KM1：主要な指標						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2019年3月期 第2四半期	2019年3月期 第1四半期	2018年3月期 第4四半期	2018年3月期 第3四半期	2018年3月期 第2四半期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	4,408,090	4,102,789	4,022,519	4,093,602	4,065,618
16	純資金流出額	2,314,818	2,231,720	2,635,674	2,384,411	2,278,945
17	連結流動性カバレッジ比率	191.1％	184.8％	153.6％	175.8％	179.7％

(2) リスク・アセットの概要

OV1：リスク・アセットの概要

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式 の該当 番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2018年9月 末	2018年6月 末	2018年9月 末	2018年6月 末
1	信用リスク	1,251,410	1,252,101	103,246	103,113
2	うち、標準的手法適用分	356,895	368,880	28,551	29,510
3	うち、内部格付手法適用分	652,752	613,555	55,353	52,029
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—	—	—
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	—	—	—	—
	その他	241,761	269,665	19,340	21,573
4	カウンターパーティ信用リスク	3,904,468	3,784,756	321,441	311,126
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	316,047	267,063	26,730	22,583
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,309,819	1,255,370	111,072	106,455
	うち、CVAリスク	1,687,271	1,737,729	134,981	139,018
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	307,586	287,845	24,606	23,027
	その他	283,743	236,748	24,050	20,040
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	1,770,226	1,745,175	150,115	147,990
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	4,174	4,742	333	379
	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	172,280	177,047	14,609	15,013
11	未決済取引	24,835	13,979	2,044	1,167
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	—	—	—	—
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	—	—	—	—
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	—	—	—
15	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	4,525,385	5,414,444	362,030	433,155
17	うち、標準的方式適用分	1,315,066	1,582,996	105,205	126,639
18	うち、内部モデル方式適用分	3,210,318	3,831,447	256,825	306,515
19	オペレーショナル・リスク	2,532,765	2,637,663	202,621	211,013
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	2,532,765	2,637,663	202,621	211,013
22	うち、先進的計測手法適用分	—	—	—	—
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	495,966	485,274	42,057	41,151
	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	—	—	—	—
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	14,981,255	15,801,376	1,198,500	1,264,110

(3) 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び信用リスク・アセットのみ
なし計算に係る信用リスクを除く。）に関する事項

CR1：資産の信用の質

(単位：百万円)

（単位：百万円）

CR 1：資産の信用の質					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		帳簿価額の総額		引当金	ネット金額 (イ+ローハ)
		デフォルトした エクスポージャー	非デフォルト エクスポージャー		
	オン・バランスシートの資産				
1	貸出金	372	606, 093	-	606, 465
2	有価証券（うち負債性のもの）	-	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの 資産（うち負債性のもの）	-	-	-	-
4	オン・バランスシートの資産の 合計（1+2+3）	372	606, 093	-	606, 465
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	-	5, 823	-	5, 823
6	コミットメント等	-	8, 625	-	8, 625
7	オフ・バランスシートの資産の 合計（5+6）	-	14, 448	-	14, 448
	合計				
8	合計（4+7）	372	620, 541	-	620, 914

(注)

デフォルトとは債務の不履行、著しく不利益となる契約条件への変更、法的破綻又はこれに類似した状態になった場合、及び債務者又は案件の信用力が非常に脆弱であり、債務の履行の不確実性が非常に高い場合をいい、株式等エクスポージャーを除く信用リスク・アセットの計測対象となる資産について、重大な損失（投下元本の30%を超える損失をいう。）を伴う売却を行う場合を含みます。

CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高の変動

(単位：百万円)

CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高の変動			
項番			金額
1	前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高		-
2	貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の当期中の要因別の変動額	デフォルトした額	372
3		非デフォルト状態へ復帰した額	-
4		償却された額	-
5		その他の変動額	-
6	当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等うち負債性のもの）の残高（1+2-3-4+5）		372

CR3：信用リスク削減手法

(単位：百万円)

CR3：信用リスク削減手法						
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		非保全 エクスポ ージャー	保全された エクスポ ージャー	担保で 保全された エクスポ ージャー	保証で 保全された エクスポ ージャー	クレジット・ デリバティブ で保全された エクスポ ージャー
1	貸出金	262, 072	344, 392	344, 392	-	-
2	有価証券（負債性のもの）	-	-	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの資 産（負債性のもの）	-	-	-	-	-
4	合計（1 + 2 + 3）	262, 072	344, 392	344, 392	-	-
5	うちデフォルトしたもの	372	-	-	-	-

CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

(単位：百万円、%)

CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		CCF・信用リスク削減手法 適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法 適用後のエクスポージャー		信用リスク・ アセットの額	リスク・ ウェイトの 加重平均値 (RWA density)
		オン・ バランス シートの額	オフ・ バランス シートの額	オン・ バランス シートの額	オフ・ バランス シートの額		
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	26, 093	-	26, 093	-	0	0. 00%
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	8, 159	-	8, 159	-	3, 794	46. 50%
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	67	-	67	-	16	23. 83%
7	国際開発銀行向け	14	-	14	-	0	0. 00%
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	2	-	2	-	0	9. 99%
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者 向け	30, 526	-	30, 526	-	7, 126	23. 34%
12	法人等向け	682, 281	-	337, 889	-	331, 909	98. 23%
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	271	-	271	-	271	100. 00%
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローン を除く。）	9, 186	-	9, 186	-	13, 779	150. 00%
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延 滞	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等 による保証付	-	-	-	-	-	-
21	出資等（重要な出資を除く。）	-	-	-	-	-	-
22	合計	756, 602	-	412, 209	-	356, 895	86. 58%

CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円)

CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー												
項番	リスク・ウェイト 資産クラス	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		信用リスク・エクスポージャーの額（CCF・信用リスク削減手法適用後）										
		0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%	合計
1	現金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	26,093	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26,093
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	550	-	36	-	7,570	-	1	-	-	-	8,159
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	63	-	0	-	3	-	-	-	67
7	国際開発銀行向け	14	-	-	-	-	-	-	-	-	-	14
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	-	2	-	-	-	-	-	-	-	-	2
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	29,068	-	291	-	1,166	-	-	-	30,526
12	法人等向け	-	-	6,234	-	1,985	-	329,669	-	-	-	337,889
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	-	-	-	-	-	-	271	-	-	-	271
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。）	-	-	-	-	-	-	-	9,186	-	-	9,186
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21	出資等（重要な出資を除く。）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	合計	26,658	2	35,402	-	9,847	-	331,112	9,186	-	-	412,209

CR 6：内部格付手法－ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円、%、千件、年)

CR 6：内部格付手法－ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バ ランス シート・ グロスエ クスポー ジャーの 額	CCF・信用 リスク削 減手法適 用前のオ フ・バラ ンスシー ト・エク スポー ジャーの 額	平均CCF	CCF・信用 リスク削 減手法適 用後EAD	平均PD	債務者の 数	平均LGD	平均残存 期間	信用リス ク・ア セットの 額	リスク・ ウェイト の加重平 均値（RWA density）	EL	適格 引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	2,048,435	-	-	2,048,435	0.00%	100件未満	45.00%	0.9	10	0.00%	0	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	62	-	-	62	0.32%	100件未満	45.00%	1.0	25	40.46%	0	
4	0.50以上0.75未満	14	-	-	14	0.66%	100件未満	45.00%	1.0	8	60.40%	0	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	16	-	-	16	9.67%	100件未満	45.00%	1.0	28	173.36%	0	
7	10.00以上100.00未満	8	-	-	8	27.56%	100件未満	45.00%	1.0	21	235.08%	1	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	2,048,537	-	-	2,048,537	0.00%	100件未満	45.00%	0.9	93	0.00%	1	-
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	1,267,743	-	-	1,267,743	0.04%	0.1	45.00%	1.3	222,592	17.55%	285	
2	0.15以上0.25未満	18,083	-	-	18,083	0.21%	100件未満	45.00%	1.2	6,467	35.76%	17	
3	0.25以上0.50未満	98,414	-	-	98,414	0.31%	100件未満	45.00%	1.1	44,117	44.82%	140	
4	0.50以上0.75未満	1,444	-	-	1,444	0.66%	100件未満	45.00%	1.2	1,135	78.62%	4	
5	0.75以上2.50未満	7,182	-	-	7,182	1.01%	100件未満	45.00%	4.7	8,771	122.12%	32	
6	2.50以上10.00未満	439	-	-	439	4.61%	100件未満	45.00%	4.7	763	173.62%	9	
7	10.00以上100.00未満	1,979	-	-	1,979	27.56%	100件未満	45.00%	2.1	4,851	245.06%	245	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	1,395,287	-	-	1,395,287	0.11%	0.2	45.00%	1.3	288,699	20.69%	734	-
事業法人向けエクスポージャー（中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。）													
1	0.00以上0.15未満	85,514	-	-	85,514	0.06%	0.2	45.00%	2.5	25,483	29.80%	26	
2	0.15以上0.25未満	3,092	-	-	3,092	0.21%	100件未満	45.00%	4.2	2,111	68.25%	2	
3	0.25以上0.50未満	9,281	-	-	9,281	0.44%	100件未満	45.00%	1.1	4,731	50.97%	18	
4	0.50以上0.75未満	7,458	3,815	100.00%	11,274	0.66%	100件未満	45.00%	4.1	13,125	116.42%	33	
5	0.75以上2.50未満	8,887	-	-	8,887	1.35%	100件未満	45.00%	1.0	9,004	101.30%	54	
6	2.50以上10.00未満	45,736	649	100.00%	46,386	4.59%	100件未満	45.00%	1.0	60,119	129.60%	959	
7	10.00以上100.00未満	50,149	1,657	95.47%	51,732	27.56%	100件未満	45.00%	1.5	137,577	265.94%	6,416	
8	100.00（デフォルト）	180	-	-	180	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	-	-	81	
9	小計	210,302	6,123	98.77%	216,350	7.79%	0.4	45.00%	1.9	252,152	116.54%	7,592	-
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(単位：百万円、%、千件、年)

CR 6：内部格付手法－ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バ ランス シート・ グロスエ クスポー ジャーの 額	CCF・信用 リスク削 減手法適 用前のオ フ・バラ ンスシー ト・エク スポー ジャーの 額	平均CCF	CCF・信用 リスク削 減手法適 用後EAD	平均PD	債務者の 数	平均LGD	平均残存 期間	信用リス ク・ア セットの 額	リスク・ ウェイト の加重平 均值（RWA density）	EL	適格 引当金
株式等エクスポージャー（PD/LGD方式が適用されるエクスポージャーに限る。）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
購入債権（事業法人等向け）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
購入債権（リテール向け）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(単位：百万円、%、千件、年)

CR 6：内部格付手法－ポートフォリオ及びデフォルト率（PD） 区分別の信用リスク・エクスポージャー													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バ ランス シート・ グロスエ クスポー ジャーの 額	CCF・信用 リスク削 減手法適 用前のオ フ・バラ ンスシー ト・エク スポー ジャーの 額	平均CCF	CCF・信用 リスク削 減手法適 用後EAD	平均PD	債務者の 数	平均LGD	平均残存 期間	信用リス ク・ア セットの 額	リスク・ ウェイト の加重平 均値（RWA density）	EL	適格 引当金
	その他リテール向けエクスポージャー												
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合計（全てのポートフォリオ）		3,654,126	6,123	98.77%	3,660,174	0.50%	0.8	45.00%	1.1	540,946	14.77%	8,329	-

(注)

ヘ欄「債務者の数」について、100件未満の場合には、概数で記載しております。

CR 7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響

(単位：百万円)

CR 7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響			
項番	ポートフォリオ	イ	ロ
		クレジット・デリバティブ 勘案前の信用リスク・ アセットの額	実際の信用リスク・ アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー－FIRB	93	93
2	ソブリン向けエクスポージャー－AIRB	-	-
3	金融機関等向けエクスポージャー－FIRB	288,699	288,699
4	金融機関等向けエクスポージャー－AIRB	-	-
5	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－FIRB	252,152	252,152
6	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－AIRB	-	-
7	特定貸付債権－FIRB	-	-
8	特定貸付債権－AIRB	-	-
9	リテール－適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	-	-
10	リテール－居住用不動産向けエクスポージャー	-	-
11	リテール－その他リテール向けエクスポージャー	-	-
12	株式－FIRB	-	-
13	株式－AIRB	-	-
14	購入債権－FIRB	-	-
15	購入債権－AIRB	-	-
16	合計	540,946	540,946

CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

(単位：百万円)

CR 8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,062,444	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	43,805
3		ポートフォリオの質	14,633
4		モデルの更新	－
5		手法及び方針	－
6		買収又は売却	－
7		為替の変動	7,151
8		その他	－
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,128,033	

(注)

項番2「資産の規模」には、項番3から項番8で特定された変動額以外の変動額を記載しております。

CR10：内部格付手法—特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）と株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）

(単位：百万円、%)

CR10：内部格付手法－特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）と株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）															
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ				
特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）															
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）以外															
規制上の区分	残存期間	オン・ バランス シートの額	オフ・ バランス シートの額	リスク・ ウェイト	エクスポージャーの額（EAD）					信用リスク・ アセットの額	期待損失				
					PF	OF	CF	IPRE	合計						
優（Strong）	2.5年未満	20,972	－	50.00%	7,621	－	－	13,350	20,972	10,486	－				
	2.5年以上	52,990	2,076	70.00%	816	8,141	－	45,590	54,548	38,183	218				
良（Good）	2.5年未満	12,764	－	70.00%	－	－	－	12,764	12,764	8,935	51				
	2.5年以上	46,795	6,249	90.00%	3,857	－	－	47,625	51,482	46,334	411				
可（Satisfactory）		4,040	－	115.00%	2,836	－	－	1,203	4,040	4,646	113				
弱い（Weak）		1,287	－	250.00%	－	287	－	1,000	1,287	3,219	103				
デフォルト（Default）		－	－	－	－	－	－	－	－	－	－				
合計		138,852	8,325	－	15,132	8,429	－	121,534	145,096	111,806	897				
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）															
規制上の区分	残存期間	オン・ バランス シートの額	オフ・ バランス シートの額	リスク・ ウェイト					エクスポー ジャーの額 （EAD）	信用リスク・ アセットの額	期待損失				
優（Strong）	2.5年未満	－	－	－					－	－	－				
	2.5年以上	－	－	－					－	－	－				
良（Good）	2.5年未満	－	－	－					－	－	－				
	2.5年以上	－	－	－					－	－	－				
可（Satisfactory）		－	－	－					－	－	－				
弱い（Weak）		－	－	－					－	－	－				
デフォルト（Default）		－	－	－					－	－	－				
合計		－	－	－					－	－	－				
株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）															
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															
カテゴリー		オン・ バランス シートの額	オフ・ バランス シートの額	リスク・ ウェイト					エクスポー ジャーの額 （EAD）	信用リスク・ アセットの額					
簡易手法－上場株式		496,263	－	300.00%					496,263	1,488,789					
簡易手法－非上場株式		70,359	－	400.00%					70,359	281,437					
内部モデル手法		－	－	－					－	－					
合計		566,622	－	－					566,622	1,770,226					
100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー															
連結自己資本規制比率告示第百四十 三条第一項ただし書の定めるところ により100%のリスク・ウェイトが 適用される株式等エクスポージャー		－	－	100.00%					－	－					

(4) カウンターパーティ信用リスクに関する事項

CCR 1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

(単位：百万円)

CCR 1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		再構築コスト	アドオン	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR	-	-		-	-	-
	カレント・エクスポージャー方式	489,202	549,993			1,017,068	316,047
2	期待エクスポージャー方式			3,755,473	1.4	5,491,304	1,309,819
3	信用リスク削減手法における簡便手法					-	-
4	信用リスク削減手法における包括的手法					6,579,165	283,743
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						1,909,611

CCR 2：CVAリスクに対する資本賦課

(単位：百万円)

CCR 2：CVAリスクに対する資本賦課			
項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	3,467,814	1,528,287
2	(i) CVAバリュエーション・リスクの額 (乗数適用後)		170,160
3	(ii) CVAストレス・バリュエーション・リスクの額 (乗数適用後)		1,358,126
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	1,200,391	158,984
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	4,668,205	1,687,271

CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円)

CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー										
項番	リスク・ウェイト 業種	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		与信相当額（信用リスク削減効果勘案後）								
		0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	0	-	28,998	-	-	-	-	-	28,998
3	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	国際開発銀行向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	4,814	5	-	-	-	-	4,820
11	法人等向け	-	-	-	-	-	10,292	-	-	10,292
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
13	上記以外	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	合計	0	-	33,812	5	-	10,292	-	-	44,111

CCR 4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー
(単位：百万円、%、千件、年)

CCR 4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
	PD区分	EAD (信用リスク 削減効果勘案 後)	平均PD	取引相手方の 数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセット	リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	1,332,186	0.01%	0.1	42.14%	0.5	28,443	2.13%
2	0.15以上0.25未満	7,011	0.21%	100件未満	45.00%	1.0	2,173	30.99%
3	0.25以上0.50未満	39,117	0.31%	100件未満	45.00%	0.9	15,749	40.26%
4	0.50以上0.75未満	9,197	0.66%	100件未満	45.00%	0.0	4,458	48.47%
5	0.75以上2.50未満	19	2.08%	100件未満	45.00%	1.0	19	97.21%
6	2.50以上10.00未満	32,457	7.29%	100件未満	45.00%	0.3	46,782	144.13%
7	10.00以上100.00未満	0	27.56%	100件未満	45.00%	0.0	1	227.01%
8	100.00 (デフォルト)	–	–	–	–	–	–	–
9	小計	1,419,990	0.19%	0.1	42.31%	0.5	97,626	6.87%
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	6,596,834	0.05%	0.3	19.78%	0.5	446,586	6.76%
2	0.15以上0.25未満	278,708	0.21%	100件未満	31.62%	0.7	58,019	20.81%
3	0.25以上0.50未満	598,224	0.36%	0.1	15.41%	1.5	130,766	21.85%
4	0.50以上0.75未満	91,071	0.66%	100件未満	14.08%	2.3	19,341	21.23%
5	0.75以上2.50未満	194,344	1.00%	100件未満	14.99%	1.5	52,494	27.01%
6	2.50以上10.00未満	32,259	6.28%	100件未満	8.89%	1.6	10,062	31.19%
7	10.00以上100.00未満	29,648	27.56%	100件未満	15.21%	0.6	23,990	80.91%
8	100.00 (デフォルト)	38	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	–	–
9	小計	7,821,129	0.24%	0.8	19.62%	0.7	741,260	9.47%
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	2,534,399	0.06%	5.0	31.32%	1.1	300,637	11.86%
2	0.15以上0.25未満	202,071	0.21%	0.4	38.40%	0.9	61,917	30.64%
3	0.25以上0.50未満	330,927	0.35%	0.4	29.75%	0.8	118,237	35.72%
4	0.50以上0.75未満	195,170	0.66%	0.2	28.89%	0.9	92,090	47.18%
5	0.75以上2.50未満	331,139	1.60%	0.3	25.02%	0.7	179,016	54.06%
6	2.50以上10.00未満	131,726	6.74%	0.3	35.40%	0.9	168,422	127.85%
7	10.00以上100.00未満	76,851	27.56%	1.5	29.75%	1.1	133,342	173.50%
8	100.00 (デフォルト)	21	100.00%	100件未満	–	2.6	–	–
9	小計	3,802,307	1.05%	8.4	31.00%	1.0	1,053,665	27.71%
合計 (全てのポートフォリオ)		13,043,426	0.47%	9.4	25.41%	0.8	1,892,552	14.50%

(注)

ハ欄「取引相手方の数」について、100件未満の場合には、概数で記載しております。

CCR 5 : 担保の内訳

(単位 : 百万円)

CCR 5 : 担保の内訳							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理 されている	分別管理 されていない	分別管理 されている	分別管理 されていない		
1	現金 (国内通貨)	-	816,574	-	1,682,947	2,400,877	7,245,031
2	現金 (外国通貨)	-	2,442,681	-	1,143,458	36,777,115	32,465,660
3	国内ソブリン債	53,619	225,223	257,863	85,337	6,451,806	4,096,073
4	その他ソブリン債	173,390	285,366	22,557	154,093	30,959,196	30,130,632
5	政府関係機関債	5,987	2,358	-	-	2,325,221	1,980,773
6	社債	14,843	171,443	929	19,810	3,026,889	11,007,186
7	株式	2,802	275,830	-	546,796	3,320,499	3,838,283
8	その他担保	-	7,661	-	-	14,744	17,240
9	合計	250,643	4,227,137	281,350	3,632,442	85,276,347	90,780,879

CCR 6 : クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

(単位 : 百万円)

CCR 6 : クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
	想定元本		
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	8,374,798	8,741,665
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	5,714,321	5,180,381
3	トータル・リターン・スワップ	746,621	244,547
4	クレジットオプション	-	-
5	その他のクレジット・デリバティブ	-	-
6	想定元本合計	14,835,741	14,166,595
	公正価値		
7	プラスの公正価値 (資産)	78,476	210,197
8	マイナスの公正価値 (負債)	△199,721	△54,058

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番			信用リスク・アセットの額
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額		1,255,370
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	32,858
3		取引相手方の信用力	△4,697
4		モデルの更新（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	－
5		手法及び方針（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	－
6		買収又は売却	－
7		為替の変動	26,288
8		その他	－
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額		1,309,819

CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

(単位：百万円)

CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー（信用リスク削減手法適用後）	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		172,685
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	3,805,279	76,105
3	（i）派生商品取引（上場以外）	2,991,043	59,820
4	（ii）派生商品取引（上場）	673,345	13,466
5	（iii）レポ形式の取引	140,890	2,817
6	（iv）クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	—	
8	分別管理されていない当初証拠金	373,921	7,478
9	事前拠出された清算基金	155,321	89,101
10	未拠出の清算基金	—	—
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		134,900
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	89,723	78,334
13	（i）派生商品取引（上場以外）	58,410	58,410
14	（ii）派生商品取引（上場）	16,861	16,299
15	（iii）レポ形式の取引	14,451	3,624
16	（iv）クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
17	分別管理されている当初証拠金	—	
18	分別管理されていない当初証拠金	27,403	27,401
19	事前拠出された清算基金	2,333	29,163
20	未拠出の清算基金	—	—

(5) 証券化エクスポージャーに関する事項

SEC 1：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーについては、該当ございません。

SEC 2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

（単位：百万円）

SEC 2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）										
項番	原資産の種類	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
		資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リテール（合計）	—	—	—	24,643	—	24,643	55,327	—	55,327
2	担保付住宅ローン	—	—	—	24,643	—	24,643	45,882	—	45,882
3	クレジットカード債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	9,444	—	9,444
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール（合計）	—	—	—	—	—	—	84,957	164	85,121
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	68,928	—	68,928
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	2,169	164	2,333
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	3,299	—	3,299
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	10,560	—	10,560
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

SEC 3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）

信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーについては、該当ございません。

SEC 4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）

信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーについては、該当ございません。

(6) マーケット・リスクに関する事項

MR 1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額

（単位：百万円）

MR 1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額		
項番		リスク・アセット （リスク相当額を 8 パーセントで除して得た額）
1	金利リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額	—
2	株式リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額	—
3	外国為替リスクの額	—
4	コモディティ・リスクの額	—
	オプション取引	
5	簡便法により算出した額	—
6	デルタ・プラス法により算出した額	—
7	シナリオ法により算出した額	—
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	1,315,066
9	合計	1,315,066

MR 2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

(単位：百万円)

MR 2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュエーション・アセット・リスク	ストレステスト・バリュエーション・アセット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計	
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	664,808	1,619,072	1,458,706	88,859		3,831,447	
1b	前四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	1.02	0.85	1.00	1.00		0.95	
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	649,964	1,888,698	1,458,706	88,859		4,086,229	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△10,630	△709,976	△124,160	391		△844,375
3		モデルの更新又は変更	△132,982	—	—	—		△132,982
4		手法及び方針	—	—	—	—		—
5		買収及び売却	—	—	—	—		—
6		為替の変動	12,955	30,158	34,144	2,283		79,541
7		その他	—	—	—	—		—
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	519,306	1,208,880	1,368,690	91,534		3,188,412	
8b	当四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	0.93	1.04	1.00	1.00		1.00	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	485,457	1,264,635	1,368,690	91,534		3,210,318	

MR 3：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）

(単位：百万円)

MR 3：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）		
項番		
	バリュエーション・アセット・リスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99%）	
1	最大値	19,771
2	平均値	15,519
3	最小値	11,427
4	期末	13,848
	ストレステスト・バリュエーション・アセット・リスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99%）	
5	最大値	71,777
6	平均値	38,649
7	最小値	25,967
8	期末	32,237
	追加的リスクの額（片側信頼区間99.9%）	
9	最大値	141,833
10	平均値	113,166
11	最小値	104,567
12	期末	109,495
	包括的リスクの額（片側信頼区間99.9%）	
13	最大値	8,033
14	平均値	7,143
15	最小値	6,175
16	期末	7,323
17	フロア（修正標準的方式）	
		6,912

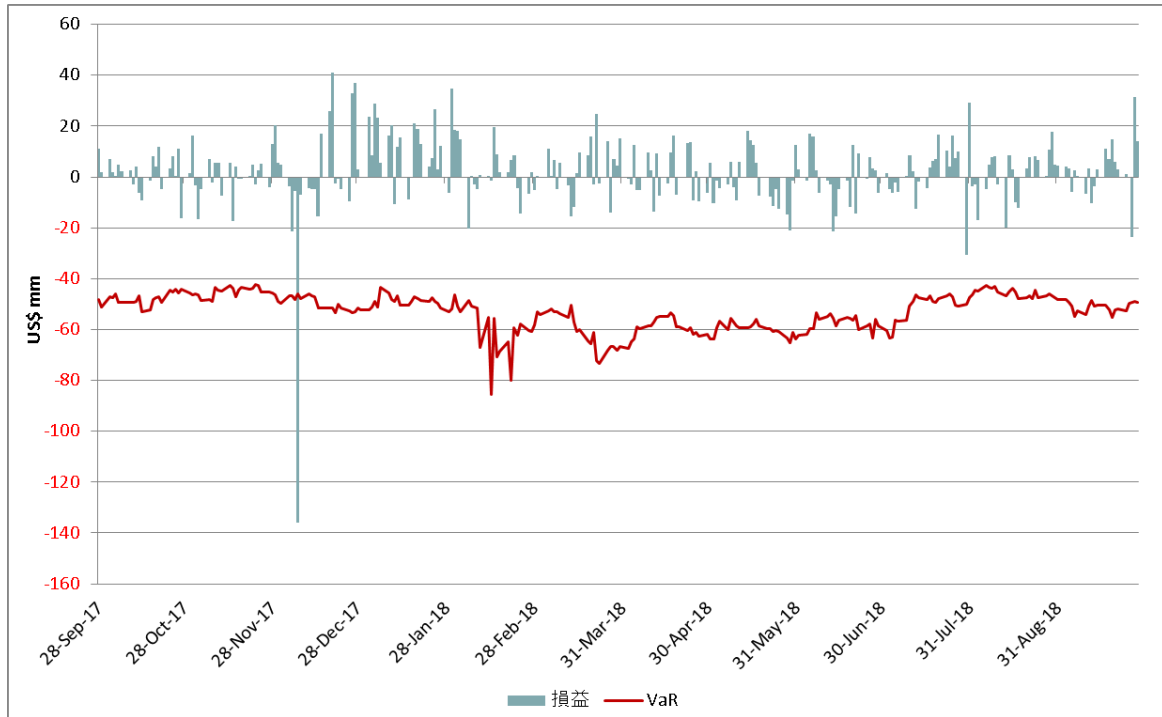
MR 4：内部モデル方式のバック・テストの結果

直近250営業日分において、グループ・レベルでのバックテスト超過が1件発生しました。

超過日：（VaR計測日）2017年12月7日 （損失発生日）2017年12月8日

超過額：約90百万ドル

超過の主要な要因：証券担保ローンにおいて、担保株式の株価急落により当初想定した価格での売却によるローン金額の回収が極めて困難となったため、評価損が発生



(7) 非トレーディング勘定における金利リスクに関する事項

① 金利ショックに対する経済的価値の減少額として計測されるもの（ Δ EVE）

第三の柱に関する告示の定めるパラレルシフト・シナリオに基づき推計される Δ EVEは、2018年9月期末において弊社グループのTier 1の額の1%未満であるため、重要性が低いものと考えられることから、詳細数値の開示を省略しております。

② 金利ショックに対する金利収益の減少額として計測されるもの（ Δ NII）

野村の資産負債構成における Δ NIIは、非トレーディング勘定において貸出金と預金が重要な位置を占める商業銀行の一般的なビジネス・モデルにおける Δ NIIと比較して重要性が低く、かつ比較可能性に欠けるものであることから、開示は省略しております。

第5章 定量的な開示事項（前中間期末分）

1. 連結自己資本規制比率に関する事項

（単位：十億円、％）

2017年9月末

連結における普通株式等Tier1資本の額	(A)	2,598.7
連結におけるTier1資本の額	(B)	2,740.5
連結における総自己資本の額	(C)	2,833.8
リスク・アセット	(D) = (E) + (F) + (G)	14,867.8
信用リスク・アセットの額の合計額	(E)	7,970.2
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)	4,216.6
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)	2,681.0
連結普通株式等Tier1比率	(A) / (D) × 100	17.4％
連結Tier1比率	(B) / (D) × 100	18.4％
連結総自己資本規制比率	(C) / (D) × 100	19.0％

2. 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）

2017年9月末

	EAD	所要自己資本額
信用リスク	23,688.7	668.7
内部格付手法	18,218.4	459.8
金融機関等向けエクスポージャー	9,511.4	80.9
ソブリン向けエクスポージャー	3,481.6	13.4
事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く）	4,045.7	132.0
事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権）	107.8	8.4
株式等エクスポージャー	715.4	178.7
マーケット・ベース方式の簡易手法適用分	715.4	178.7
経過措置適用分	—	—
その他	305.8	29.2
信用リスク・アセットのみなし計算	50.8	17.2
標準的手法	796.8	33.4
中央清算機関関連エクスポージャー	4,673.5	27.0
CVAリスク	—	148.5
マーケット・リスク	—	337.3
内部モデル方式および外部格付準拠方式	—	337.3
オペレーショナル・リスク	—	214.5
粗利益配分手法	—	214.5
連結総所要自己資本額	—	1,189.4

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、会社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、会社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、会社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。

3. 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)

	2017年9月末		
	デリバティブ	レポ形式の取引	その他
国内	1,446.0	1,443.1	2,612.0
海外	2,550.0	8,295.5	1,821.0
欧州	1,613.3	1,757.7	830.8
北米	572.6	5,757.8	789.1
アジア	364.1	780.0	201.2
合計	3,995.9	9,738.6	4,433.0
標準的手法適用分	—	—	796.8

② 業種別内訳

(単位：十億円)

	2017年9月末		
	デリバティブ	レポ形式の取引	その他
銀行	1,587.9	5,250.5	1,238.1
ブローカー／ディーラー	338.0	975.5	32.5
その他金融・保険	1,364.8	2,145.4	269.2
国・地方公共団体等	283.5	1,304.4	1,822.5
消費関連産業	68.6	54.1	35.7
その他	353.2	8.6	1,035.0
合計	3,995.9	9,738.6	4,433.0
標準的手法適用分	—	—	796.8

③ 残存期間別内訳

(単位：十億円)

	2017年9月末		
	デリバティブ	レポ形式の取引	その他
1年未満	290.8	8,490.6	297.8
1年以上3年未満	153.1	719.1	2,848.2
3年以上5年未満	38.3	191.3	55.2
5年以上	3,513.7	337.5	17.5
期間の定めのないもの	—	—	1,214.3
合計	3,995.9	9,738.6	4,433.0
標準的手法適用分	—	—	796.8

- 1 エクスポートの額については、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ト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、会社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トについて、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1,250%のリスク・ウェイトが適用されるエクスポートの額

(単位：十億円)

リスク・ウェイト	2017年9月末	
	信用リスク削減手法の効果を勘案した後の エクスポートの額	
0%		27.9
10%		—
20%		42.7
35%		—
50%		8.4
100%		372.2
150%		23.9
350%		8.3
625%		—
937.5%		—
1,250%		0.0
合計		483.4

- (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)

2017年9月末

リスク・ウェイト	
50%	34.6
70%	14.3
90%	39.0
95%	—
115%	18.8
120%	—
140%	—
250%	0.8
0%	0.2
合計	107.8

- 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7,154億円のうち、リスク・ウェイト300%適用分が5,248億円、同400%適用分が1,906億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、%)

2017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	1.33%	31.87%	—	32.55%	161.5	3,884.2	0.2	75.00%
AAA～AA－	0.03%	31.38%	—	6.15%	48.9	969.3	—	—
A＋～BBB－	0.13%	34.82%	—	22.48%	38.8	1,953.8	—	—
BB＋～CCC	4.77%	26.64%	—	78.08%	72.5	960.4	0.2	75.00%
CC～D	100.00%	43.29%	43.29%	0.00%	1.3	0.6	—	—
金融機関等向け	0.27%	20.63%	—	9.56%	1,235.2	8,276.2	—	—
AAA～AA－	0.03%	14.76%	—	2.75%	295.9	3,523.8	—	—
A＋～BBB－	0.11%	25.82%	—	12.53%	912.7	4,214.0	—	—
BB＋～CCC	3.41%	13.21%	—	28.55%	26.6	538.4	—	—
CC～D	—	—	—	—	—	—	—	—
ソブリン向け	0.07%	49.16%	—	3.87%	1,819.4	1,662.2	—	—
AAA～AA－	0.00%	49.46%	—	0.16%	1,819.4	1,218.6	—	—
A＋～BBB－	0.09%	44.89%	—	12.29%	0.0	409.4	—	—
BB＋～CCC	5.93%	73.38%	—	232.91%	—	34.3	—	—
CC～D	—	—	—	—	—	—	—	—
合計	0.48%	29.13%	—	13.86%	3,216.1	13,822.6	0.2	75.00%
AAA～AA－	0.02%	30.29%	—	2.19%	2,164.2	5,711.7	—	—
A＋～BBB－	0.11%	29.24%	—	15.15%	951.5	6,577.2	—	—
BB＋～CCC	4.30%	22.97%	—	64.18%	99.0	1,533.0	0.2	75.00%
CC～D	100.00%	43.29%	43.29%	0.00%	1.3	0.6	—	—

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、％）

2017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	0.38%	42.46%	—	12.79%	1,808.2	2,897.2	0.2	75.00%
AAA～AA－	0.01%	45.06%	—	2.45%	1,521.0	1,304.9	—	—
A＋～BBB－	0.10%	39.31%	—	18.95%	254.7	1,427.7	—	—
BB＋～CCC	7.73%	32.14%	—	108.80%	31.8	164.6	0.2	75.00%
CC～D	100.00%	45.00%	45.00%	0.00%	0.7	—	—	—
欧州	0.87%	38.71%	—	21.65%	611.9	3,441.8	—	—
AAA～AA－	0.01%	58.51%	—	3.42%	399.0	667.1	—	—
A＋～BBB－	0.13%	34.83%	—	20.48%	168.4	2,125.8	—	—
BB＋～CCC	4.64%	21.07%	—	53.54%	44.5	649.0	—	—
CC～D	—	—	—	—	—	—	—	—
北米	0.23%	15.73%	—	9.44%	608.6	6,339.1	—	—
AAA～AA－	0.03%	11.19%	—	1.45%	218.3	3,619.2	—	—
A＋～BBB－	0.08%	21.16%	—	9.85%	381.1	2,139.5	—	—
BB＋～CCC	2.18%	22.06%	—	59.69%	9.2	580.4	—	—
CC～D	100.00%	45.00%	45.00%	0.00%	—	0.0	—	—
アジア	0.99%	22.78%	—	16.95%	187.4	1,144.5	—	—
AAA～AA－	0.03%	40.57%	—	7.77%	25.9	120.6	—	—
A＋～BBB－	0.18%	20.15%	—	10.06%	147.4	884.3	—	—
BB＋～CCC	6.54%	23.35%	—	72.47%	13.5	139.1	—	—
CC～D	100.00%	42.37%	42.37%	0.00%	0.6	0.6	—	—
合計	0.48%	29.13%	—	13.86%	3,216.1	13,822.6	0.2	75.00%
AAA～AA－	0.02%	30.29%	—	2.19%	2,164.2	5,711.7	—	—
A＋～BBB－	0.11%	29.24%	—	15.15%	951.5	6,577.2	—	—
BB＋～CCC	4.30%	22.97%	—	64.18%	99.0	1,533.0	0.2	75.00%
CC～D	100.00%	43.29%	43.29%	0.00%	1.3	0.6	—	—

- 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、会社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

会社グループにおいて、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

会社グループでは、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）、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。

また会社グループにおいて、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。

4. 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)

2017年9月末

	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	6,463.6	—	—	158.9
金融機関等向けエクスポージャー	5,228.9	—	—	—
ソブリン向けエクスポージャー	57.1	—	—	158.9
事業法人向けエクスポージャー	1,177.6	—	—	—

- 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。

5. 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)

2017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)	972.8	2,391.1	3,363.8
外国為替関連取引および金関連取引		64.0	75.0	139.1
金利関連取引		264.2	213.2	477.4
株式関連取引		624.1	2,008.5	2,632.6
貴金属関連取引（金を除く）		0.1	0.4	0.5
その他のコモディティ関連取引		12.9	52.5	65.4
クレジット・デリバティブ取引		7.5	41.4	48.9
長期決済期間取引	(B)	—	—	—
一括清算ネットティング契約による与信相	(C)	—	—	1,798.7
当額削減効果（△）				
ネットの与信相当額	(D) = (A) + (B) - (C)	—	—	1,565.2
担保の額	(E)	—	—	169.3
金融資産担保		—	—	169.3
与信相当額（担保勘案後）	(D) - (E)	—	—	1,395.9

- 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)

2017年9月末

	提供	購入
クレジット・デフォルト・スワップ（個別）	10,033.0	9,968.5
クレジット・デフォルト・スワップ（指数）	4,731.8	4,738.8
その他のクレジット・リスク関連ポートフォリオ商品	469.4	137.6
クレジット・リスク関連オプションおよびスワプション	3.3	29.2
合計	15,237.5	14,874.2

6. 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)

2017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	68.1	5.7	30.5
CMBS	3.3	—	3.3
CDO/CLO	69.6	1.0	38.3
Consumer	2.0	—	1.1
Commercial	0.0	—	0.0
その他	0.6	—	0.1
合計	143.6	6.7	73.4

(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)

2017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	9.8	—	0.1	—
1.6%超4%以下	16.9	—	0.4	—
4%超8%以下	14.3	0.0	0.9	0.0
8%超20%以下	7.4	5.6	1.0	0.7
20%超100%未満	21.8	—	9.5	—
100%	73.4	1.0	73.1	1.0
合計	143.6	6.7	85.0	1.7

- 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。
- 無格付の証券化エクスポージャーのうち、集中レシオ方式を採用した銘柄については、適用したリスク・ウェイトに基づいて区分しております。

(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)

2017年9月末	
エクスポージャーの総額	
ヘッジ込み	228.4
ヘッジ除外	180.6

(単位：十億円)

2017年9月末	
所要自己資本	
デフォルト	3.5
相関	0.0
クレジット・スプレッド	0.5
その他	0.3
包括的リスクの額	4.4

7. 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)

2017年4月1日～2017年9月30日				
	日次平均	最高	最低	2017年9月末
VaR (10day)	13.9	16.8	11.6	12.4

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)

2017年4月1日～2017年9月30日				
	日次平均	最高	最低	2017年9月末
ストレスVaR	29.9	45.3	17.9	44.5

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)

2017年4月1日～2017年9月30日				
	日次平均	最高	最低	2017年9月末
追加的リスク	90.4	111.5	79.3	94.0
包括的リスク	7.7	8.2	6.9	8.0

(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

2017年4月1日から2017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。

8. 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)

	2017年9月末	
	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	524.8	693.8
上記以外の株式等エクスポージャー	190.6	190.6
合計	715.4	884.4

(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)

	2017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	715.4
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	715.4

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。

第6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Tier 1 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Tier 1 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、最も劣後的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
15	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
	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、当社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

当社は、本社債の利息の支払を行わないことが必要であるとそ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、当社は、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) 当社の普通株式及びその他Tier1資本調達手段に該当する当社の株式（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当社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

当社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、当社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当社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、当社の債務で、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、当社の債務で、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

当社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当社の連結普通株式等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、当社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、当社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

当社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、当社は、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

当社について、倒産手続の開始の決定等が行われた場合、当社は、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、当社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、当社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、当社の清算手続（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、当社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	Tier 2 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	15,800百万円
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
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、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	Tier 2 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	22,680百万円
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、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	Tier 2 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	2,400百万円
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)	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、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	Tier 2 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	20,000百万円
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、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、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. 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 その他Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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)	

8. 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 その他Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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	366百万円
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)	

9. 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 その他Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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	6百万円
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)	

10. 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 その他Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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	883百万円
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)	

11. 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 その他Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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	50百万円
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)	

12. 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 その他Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 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	14百万円
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)	

13. エイト証券株式会社 非支配持分

自己資本調達手段（非支配持分）

1	発行者	エイト証券株式会社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	
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	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
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	17百万円
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7章 連結レバレッジ比率に関する開示事項（四半期）

（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	2018年9月末	2018年6月末
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	23,751,548	23,905,803
1 a	1	連結貸借対照表における総資産の額	45,360,338	42,828,466
1 b	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）	27,808	25,498
1 c	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。）	—	—
1 d	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（△）	21,580,981	18,897,164
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額（△）	241,255	240,354
3		オン・バランス資産の額（イ）	23,510,292	23,665,448
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	2,142,304	2,209,952
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	9,631,507	9,328,812
		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	289,510	257,823
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	1,314,361	1,285,007
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（△）	404,483	475,488
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	15,478,849	14,779,870
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（△）	13,908,201	12,785,110
11	4	デリバティブ取引等に関する額（ロ）	14,543,848	14,600,867
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	38,637,491	38,079,468
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額（△）	18,715,037	20,681,693
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	1,680,491	1,815,901
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）	21,602,945	19,213,677
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	1,874,816	2,221,829
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（△）	550,333	734,407

(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	2018年9月末	2018年6月末
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	1,324,482	1,487,422
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	2,713,876	2,710,931
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	60,981,569	58,967,416
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	4.45%	4.59%

(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27年金融庁告示第1100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8章 連結レバレッジ比率に関する開示事項（中間）

（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	2018年9月末	2017年9月末
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	23,751,548	23,132,742
1 a	1	連結貸借対照表における総資産の額	45,360,338	44,105,700
1 b	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）	27,808	362,531
1 c	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。）	—	—
1 d	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（△）	21,580,981	20,610,428
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額（△）	241,255	220,281
3		オン・バランス資産の額（イ）	23,510,292	22,912,461
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	2,142,304	1,858,678
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	9,631,507	9,667,512
		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	289,510	492,596
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	1,314,361	1,472,717
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（△）	404,483	487,352
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	15,478,849	16,358,178
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（△）	13,908,201	13,890,656
11	4	デリバティブ取引等に関する額（ロ）	14,543,848	15,471,672
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	38,637,491	38,947,760
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額（△）	18,715,037	20,369,365
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	1,680,491	1,869,980
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）	21,602,945	20,448,375
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	1,874,816	1,499,250
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（△）	550,333	472,708

(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	2018年9月末	2017年9月末
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	1,324,482	1,026,542
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	2,713,876	2,740,476
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	60,981,569	59,859,050
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	4.45%	4.57%

(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27年金融庁告示第1100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 (2019年3月期 第2 四半期)		前最終指定親会社四半期 (2019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	4,408,090		4,102,789	
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	415,324	45,447	415,282	52,297
3	うち、安定預金の額	—	—	—	—
4	うち、準安定預金の額	415,324	45,447	415,282	52,297
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,332,630	1,175,723	1,313,032	1,138,637
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	2,497	2,497	—	—
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	1,064,508	907,601	1,082,820	908,425
8	うち、負債性有価証券の額	268,122	268,122	230,212	230,212
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	2,886,409		2,916,726	
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	2,763,221	2,492,770	2,742,299	2,483,434
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	2,368,008	2,368,008	2,382,607	2,382,607
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	395,213	124,762	359,692	100,826
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,085,052	1,031,706	5,376,835	1,135,856
15	偶発事象に係る資金流出額	471,264	225,362	535,471	250,478
16	資金流出合計額	7,859,913		7,977,427	
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	31,402,370	2,167,335	32,047,015	2,285,614
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	988,357	903,163	952,853	868,559
19	その他資金流入額	5,598,236	2,474,597	6,432,130	2,591,533
20	資金流入合計額	37,988,963	5,545,095	39,431,998	5,745,707
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	4,408,090		4,102,789	
22	純資金流出額	2,314,818		2,231,720	
23	連結流動性カバレッジ比率	191.1%		184.8%	
24	平均値計算用データ数	62		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

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

会社グループの第2四半期連結会計期間の日次平均適格流動資産の合計額は前四半期比3,053億1百万円増の4兆4,080億90百万円となりました。資金提供義務に基づく資金流出額等が同1,041億51百万円減の1兆317億6百万円、有担保資金運用等に係る資金流入額が同1,182億79百万円減の2兆1,673億35百万円、その他の資金流入額（主にデリバティブ取引等）が同1,169億37百万円減の2兆4,745億97百万円、純資金流出額は同830億98百万円増の2兆3,148億18百万円となりました。

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日次平均は191.1%となりました。

会社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、有価証券売買及び貸借取引に伴うトレーディング在庫の変動やデリバティブ取引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

会社グループの第2四半期連結会計期間の日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、会社グループでは、連結流動性カバレッジ比率に関するリスク・アペタイトを定め、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。

第3部 開示方針

「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」に基づき、開示情報の信頼性を維持・確保することを目的として、「最終指定親会社の経営の健全性の状況に係る開示方針」（以下、「当開示方針」といいます。）を定め、経営会議にて承認を得ております。

当開示方針に従い、情報開示委員会及びCFOは、本開示が、作成部署により定められた手続きに従って適切に作成されていることを確認しております。本開示は開示後速やかに経営会議に報告されます。また、手続きの有効性については、定期的にインターナル・オーディット部門の内部監査を受けております。

