

2020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 2020年4月1日  
(第117期) 至 2020年9月30日

野村ホールディングス株式会社

(注) 2021年6月30日付で、連結自己資本規制比率等の訂正を実施しております。

## 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   | 14 |
| 1. 連結の範囲   | 14 |
| 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  | 15 |
| 第3章 定量的な開示事項   | 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. その他定量的な開示事項   | 19 |
| 第4章 自己資本調達手段に関する契約内容   | 54 |
| 1. 野村ホールディングス株式会社 普通株式                                       | 54 |
| 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） | 56 |
| 3. 野村ホールディングス株式会社 第2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）           | 59 |
| 4. 野村ホールディングス株式会社 第2回無担保社債（劣後特約付）                            | 62 |
| 5. 野村ホールディングス株式会社 第3回期限前償還条項付無担保社債（劣後特約付）                    | 66 |
| 6. 野村ホールディングス株式会社 第4回期限前償還条項付無担保変動利付社債（劣後特約付）                | 70 |
| 7. 野村ホールディングス株式会社 第5回期限前償還条項付無担保社債（劣後特約付）                    | 74 |
| 8. 非支配株主持分   | 78 |
| 第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項  | 80 |
| 第2部 連結流動性規制に関する開示  | 82 |
| 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                                  | 83 |
| 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                                  | 84 |
| 第3部 開示方針   | 85 |

# 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

(単位：百万円、%)

| CC1：自己資本の構成                    |   |           |           |                               |
|--------------------------------|---|-----------|-----------|-------------------------------|
| 国際様式の該<br>当番号                  | 項目                                      | イ         |           | ロ                             |
|                                |   | 2020年9月末  | 2020年6月末  | 別紙様式<br>第八号<br>(CC2)<br>の参照項目 |
| <b>普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目(1)</b> |   |           |           |                               |
| 1a+2-1c-26                     | 普通株式に係る株主資本の額                           | 2,816,950 | 2,801,951 |                               |
| 1a                             | うち、資本金及び資本剰余金の額                         | 1,277,726 | 1,270,533 | 1a                            |
| 2                              | うち、利益剰余金の額                              | 1,772,538 | 1,765,701 | 2                             |
| 1c                             | うち、自己株式の額(△)                            | 233,314   | 234,282   | 1c                            |
| 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                 | △88,705   | △25,973   | 3                             |
| 5                              | 普通株式等Tier1 資本に係る調整後非支配株主持分の額            | —         | —         |                               |
| 6                              | 普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額(イ)               | 2,728,244 | 2,775,978 |                               |
| <b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b> |   |           |           |                               |
| 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 | 106,592   | 109,381   |                               |
| 8                              | うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額              | 12,445    | 13,138    |                               |
| 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    | 94,146    | 96,242    |                               |
| 10                             | 繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額                 | 4,501     | 795       |                               |
| 11                             | 繰延ヘッジ損益の額                               | —         | —         |                               |
| 12                             | 適格引当金不足額                                | 42,841    | 37,585    |                               |
| 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      | 20,552    | 66,179    |                               |
| 15                             | 退職給付に係る資産の額                             | 14,293    | 13,965    |                               |
| 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           | 1,750     | 1,625     |                               |
| 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<br>当番号                | 項目  | イ                              |           | ロ                             |  |
|------------------------------|---|--------------------------------|-----------|-------------------------------|--|
|                              |   | 2020年9月末                       | 2020年6月末  | 別紙様式<br>第八号<br>(CC2)<br>の参照項目 |  |
| 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)                          | 190,532                        | 229,533   |                               |  |
| <b>普通株式等Tier1 資本</b>         |   |                                |           |                               |  |
| 29                           | 普通株式等Tier1 資本の額((イ)－(ロ)) (ハ)                        | 2,537,712                      | 2,546,444 |                               |  |
| <b>その他Tier1 資本に係る基礎項目(3)</b> |   |                                |           |                               |  |
| 30                           | 31a   | その他Tier1 資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳 | —         | —                             |  |
|                              | 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         | 315,000   | 315,000                       |  |
|                              |   | 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 資本に係る調整後非支配株主持分等の額                         | 2,617                          | 2,906     |                               |  |
| 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)                            | 317,617                        | 317,906   |                               |  |

(単位：百万円、%)

| 国際様式の該<br>当番号             | 項目   | イ         |           | ロ                             |
|---------------------------|--|-----------|-----------|-------------------------------|
|                           |  | 2020年9月末  | 2020年6月末  | 別紙様式<br>第八号<br>(CC2)<br>の参照項目 |
| <b>その他Tier1 資本に係る調整項目</b> |  |           |           |                               |
| 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)                           | —         | —         |                               |
| <b>その他Tier1 資本</b>        |  |           |           |                               |
| 44                        | その他Tier1 資本の額((ニ)－(ホ)) (へ)                         | 317,617   | 317,906   |                               |
| <b>Tier1 資本</b>           |  |           |           |                               |
| 45                        | Tier1 資本の額((ハ)＋(へ)) (ト)                            | 2,855,329 | 2,864,351 |                               |
| <b>Tier2 資本に係る基礎項目(4)</b> |  |           |           |                               |
| 46                        | Tier2 資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳                        | —         | —         |                               |
|                           | 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 資本に係る調整後非支配株主持分等の額                           | 615       | 683       |                               |
| 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        | 30,440    | 30,440    |                               |
| 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           | 30,440    | 30,440    |                               |
| 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 算入額の合計額               | —         | —         |                               |
| 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)                              | 31,055    | 31,123    |                               |

(単位：百万円、%)

| 国際様式の該<br>当番号                | 項目  | イ          |            | ロ                             |
|------------------------------|---|------------|------------|-------------------------------|
|                              |   | 2020年9月末   | 2020年6月末   | 別紙様式<br>第八号<br>(CC2)<br>の参照項目 |
| <b>Tier2資本に係る調整項目(5)</b>     |   |            |            |                               |
| 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 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額           | —          | —          |                               |
| 54                           | 少数出資金融機関等のTier2 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額                   | —          | —          |                               |
| 54a                          | 少数出資金融機関等のその他外部TLAC関連調達手段のうち、マーケット・メイク目的保有TLACに該当しなくなったものの額 | —          | —          |                               |
| 55                           | その他金融機関等のTier2 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額                    | —          | —          |                               |
| 57                           | Tier2 資本に係る調整項目の額 (リ)                                       | —          | —          |                               |
| <b>Tier2 資本</b>              |   |            |            |                               |
| 58                           | Tier2 資本の額((チ)－(リ)) (ヌ)                                     | 31,055     | 31,123     |                               |
| <b>総自己資本</b>                 |   |            |            |                               |
| 59                           | 総自己資本の合計((ト)＋(ヌ)) (ル)                                       | 2,886,385  | 2,895,475  |                               |
| <b>リスク・アセット(6)</b>           |   |            |            |                               |
| 60                           | リスク・アセットの額 (ヲ)  | 15,037,167 | 16,092,669 |                               |
| <b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b> |   |            |            |                               |
| 61                           | 連結普通株式等Tier1 比率((ハ)／(ヲ))                                    | 16.87%     | 15.82%     |                               |
| 62                           | 連結Tier1 比率((ト)／(ヲ))   | 18.98%     | 17.79%     |                               |
| 63                           | 連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))  | 19.19%     | 17.99%     |                               |
| 64                           | 最低連結資本バッファ比率  | 3.01%      | 3.01%      |                               |
| 65                           | うち、資本保全バッファ比率   | 2.50%      | 2.50%      |                               |
| 66                           | うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率                                       | 0.01%      | 0.01%      |                               |
| 67                           | うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率                                       | 0.50%      | 0.50%      |                               |
| 68                           | 連結資本バッファ比率  | 11.19%     | 9.99%      |                               |
| <b>調整項目に係る参考事項(8)</b>        |   |            |            |                               |
| 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                               | 149,595    | 125,061    |                               |
| 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                       | 133,116    | 130,880    |                               |
| 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                            | 4,838      | 4,176      |                               |

(単位：百万円、%)

| 国際様式の該<br>当番号                              | 項目   | イ        |          | ロ                             |
|--|--|----------|----------|-------------------------------|
|  |  | 2020年9月末 | 2020年6月末 | 別紙様式<br>第八号<br>(CC2)<br>の参照項目 |
| <b>Tier2 資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項(9)</b> |  |          |          |                               |
| 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  | —        | —        |                               |
| <b>資本調達手段に係る経過措置に関する事項(10)</b>             |  |          |          |                               |
| 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  | 30,440   | 30,440   |                               |
| 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。）                               | 122,560  | 122,560  |                               |

(単位：百万円、%)

| 自己資本の構成                        |   |           |
|--------------------------------|---|-----------|
| 国際様式の該当番号                      | 項目  | 2019年9月末  |
| <b>普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目(1)</b> |   |           |
| 1a+2-1c-26                     | 普通株式に係る株主資本の額                             | 2,773,327 |
| 1a                             | うち、資本金及び資本剰余金の額                           | 1,277,344 |
| 2                              | うち、利益剰余金の額                                | 1,636,353 |
| 1c                             | うち、自己株式の額(△)                              | 140,369   |
| 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                   | △67,442   |
| 5                              | 普通株式等Tier1 資本に係る調整後非支配株主持分の額              | 6         |
| 6                              | 普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額(イ)                 | 2,705,891 |
| <b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b> |   |           |
| 8+9                            | 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を除く。)の額の合計額 | 105,332   |
| 8                              | うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額                | 1,310     |
| 9                              | うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライセンスに係るもの以外のものの額    | 104,021   |
| 10                             | 繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額                   | 1,538     |
| 11                             | 繰延ヘッジ損益の額                                 | —         |
| 12                             | 適格引当金不足額                                  | 33,556    |
| 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        | 24,611    |
| 15                             | 前払年金費用の額                                  | 11,802    |
| 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              | 4,695     |
| 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  | 2019年9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)                          | 181,538                       |         |
| <b>普通株式等Tier1 資本</b>         |   |                               |         |
| 29                           | 普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)                        | 2,524,353                     |         |
| <b>その他Tier1 資本に係る基礎項目(3)</b> |   |                               |         |
| 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                     | 1,930                         |         |
| 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)                            | 166,930                       |         |

(単位：百万円、%)

| 国際様式の該<br>当番号             | 項目   | 2019年9月末  |
|---------------------------|--|-----------|
| <b>その他Tier1 資本に係る調整項目</b> |  |           |
| 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)                           | —         |
| <b>その他Tier1 資本</b>        |  |           |
| 44                        | その他Tier1 資本の額((ニ)－(ホ)) (ヘ)                         | 166,930   |
| 45                        | Tier1 資本の額((ハ)＋(ヘ)) (ト)                            | 2,691,284 |
| <b>Tier2 資本に係る基礎項目(4)</b> |  |           |
| 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                       | 455       |
| 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        | 45,660    |
| 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           | 45,660    |
| 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)                              | 46,115    |

(単位：百万円、%)

| 国際様式の該<br>当番号                | 項目  | 2019年9月末   |
|------------------------------|---|------------|
| <b>Tier2資本に係る調整項目(5)</b>     |   |            |
| 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 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額           | —          |
| 54                           | 少数出資金融機関等のTier2 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額                   | —          |
| 54a                          | 少数出資金融機関等のその他外部TLAC関連調達手段のうち、マーケット・メイク目的保有TLACに該当しなくなったものの額 | —          |
| 55                           | その他金融機関等のTier2 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額                    | —          |
| 57                           | Tier2 資本に係る調整項目の額 (リ)                                       | —          |
| <b>Tier2 資本</b>              |   |            |
| 58                           | Tier2 資本の額((チ)－(リ)) (ヌ)                                     | 46,115     |
| <b>総自己資本</b>                 |   |            |
| 59                           | 総自己資本の合計((ト)＋(ヌ)) (ル)                                       | 2,737,400  |
| <b>リスク・アセット(6)</b>           |   |            |
| 60                           | リスク・アセットの額 (ヲ)  | 14,576,989 |
| <b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b> |   |            |
| 61                           | 連結普通株式等Tier1 比率((ハ)／(ヲ))                                    | 17.31%     |
| 62                           | 連結Tier1 比率((ト)／(ヲ))   | 18.46%     |
| 63                           | 連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))  | 18.77%     |
| 64                           | 最低連結資本バッファ比率  | 3.12%      |
| 65                           | うち、資本保全バッファ比率   | 2.50%      |
| 66                           | うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率                                       | 0.12%      |
| 67                           | うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率                                       | 0.50%      |
| 68                           | 連結資本バッファ比率  | 10.77%     |
| <b>調整項目に係る参考事項(8)</b>        |   |            |
| 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                               | 122,639    |
| 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                       | 176,856    |
| 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                            | 2,490      |

(単位：百万円、%)

| 国際様式の該<br>当番号                              | 項目   | 2019年9月末 |
|--|--|----------|
| <b>Tier2 資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項(9)</b> |  |          |
| 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  | —        |
| <b>資本調達手段に係る経過措置に関する事項(10)</b>             |  |          |
| 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  | 45,660   |
| 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。）                               | 107,540  |

## 第2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

2020年9月末において、野村証券株式会社(日本・証券業)、ノムラ・インターナショナルPLC(英国・証券業)、ノムラ・セキュリティーズ・インターナショナルInc.(米国・証券業)、ノムラ・インターナショナル(ホンコン)LIMITED(香港・証券業)、野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービス株式会社(日本・証券業)など188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、2020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0.6億円)、  
Nomura Reinsurance 1 IC Limited (ガーンジー、保険業、総資産707億円、純資産17億円)、  
Nomura Reinsurance 3 IC 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 5IC Limited (ガーンジー、保険業、総資産1億円、純資産1億円)、  
US CB Reinsurance 1 IC Limited (ガーンジー、保険業、総資産12億円、純資産12億円)、  
Nomura Americas Re Ltd. (バミューダ、保険業、総資産1,446億円、純資産65億円)、  
Nomura Americas US Re Ltd. (バミューダ、保険業、総資産28億円、純資産26億円)、  
その他VIE1, 121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

2020年9月末

(単位：百万円)

| CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係 |                   |                             |                       |
|-------------------------------------|-------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 項目                                  | イ                 | ロ                           | ハ                     |
|                                     | 公表<br>連結貸借対照表     | 規制上の連結範囲<br>に基づく連結貸借<br>対照表 | 別紙様式第一号<br>(CC1)の参照項目 |
| <b>資産の部</b>                         |                   |                             |                       |
| 現金および現金同等物                          | 3,941,802         | 3,921,122                   |                       |
| 定期預金                                | 191,276           | 191,276                     |                       |
| 取引所預託金およびその他の顧客分別金                  | 391,594           | 391,594                     |                       |
| 貸付金                                 | 2,344,079         | 2,337,220                   |                       |
| 顧客に対する受取債権                          | 514,711           | 514,486                     |                       |
| 顧客以外に対する受取債権                        | 877,750           | 873,536                     |                       |
| 貸倒引当金                               | △11,355           | △11,355                     |                       |
| 売戻条件付買入有価証券                         | 12,063,661        | 12,063,661                  |                       |
| 借入有価証券担保金                           | 3,502,286         | 3,502,286                   |                       |
| トレーディング資産                           | 16,515,538        | 15,454,371                  |                       |
| プライベート・エクイティ投資                      | 55,432            | 44,430                      |                       |
| 建物、土地、器具備品および設備                     | 466,372           | 430,658                     |                       |
| トレーディング目的以外の負債証券                    | 411,979           | 413,370                     |                       |
| 投資持分証券                              | 112,880           | 112,880                     |                       |
| 関連会社に対する投資および貸付金                    | 391,286           | 391,853                     |                       |
| その他                                 | 915,140           | 914,455                     |                       |
| 資産の部合計                              | 42,684,437        | 41,545,850                  |                       |
| <b>負債の部</b>                         |                   |                             |                       |
| 短期借入                                | 1,346,414         | 1,171,141                   |                       |
| 顧客に対する支払債務                          | 1,286,984         | 1,286,960                   |                       |
| 顧客以外に対する支払債務                        | 1,281,977         | 1,281,737                   |                       |
| 受入銀行預金                              | 1,181,168         | 1,181,168                   |                       |
| 買戻条件付売却有価証券                         | 15,427,476        | 15,539,555                  |                       |
| 貸付有価証券担保金                           | 1,119,094         | 1,125,099                   |                       |
| その他の担保付借入                           | 348,484           | 348,484                     |                       |
| トレーディング負債                           | 8,789,496         | 8,845,801                   |                       |
| その他の負債                              | 1,049,464         | 1,061,156                   |                       |
| 長期借入                                | 8,067,822         | 7,288,975                   |                       |
| 負債の部合計                              | 39,898,383        | 39,130,079                  |                       |
| <b>純資産の部</b>                        |                   |                             |                       |
| 資本金                                 | 594,492           | 594,492                     | 1a                    |
| 資本剰余金                               | 683,233           | 683,233                     | 1a                    |
| 利益剰余金                               | 1,775,690         | 1,771,799                   | 2                     |
| 累積的其他の包括利益                          | △88,705           | △88,705                     | 3                     |
| 自己株式                                | △233,314          | △233,314                    | 1c                    |
| 非支配持分                               | 54,657            | 54,657                      |                       |
| 純資産の部合計                             | 2,786,054         | 2,782,163                   |                       |
| <b>負債及び純資産の部合計</b>                  | <b>42,684,437</b> | <b>41,912,243</b>           |                       |

2020年6月末

(単位：百万円)

| CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係 |                   |                             |                       |
|-------------------------------------|-------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 項目                                  | イ                 | ロ                           | ハ                     |
|                                     | 公表<br>連結貸借対照表     | 規制上の連結範囲<br>に基づく連結貸借<br>対照表 | 別紙様式第一号<br>(CC1)の参照項目 |
| <b>資産の部</b>                         |                   |                             |                       |
| 現金および現金同等物                          | 3,354,792         | 3,324,911                   |                       |
| 定期預金                                | 179,485           | 179,485                     |                       |
| 取引所預託金およびその他の顧客分別金                  | 555,106           | 555,106                     |                       |
| 貸付金                                 | 2,478,896         | 2,480,972                   |                       |
| 顧客に対する受取債権                          | 352,756           | 348,198                     |                       |
| 顧客以外に対する受取債権                        | 1,136,206         | 1,131,568                   |                       |
| 貸倒引当金                               | △12,354           | △12,354                     |                       |
| 売戻条件付買入有価証券                         | 10,989,036        | 10,989,036                  |                       |
| 借入有価証券担保金                           | 3,436,806         | 3,436,806                   |                       |
| トレーディング資産                           | 16,698,156        | 15,634,249                  |                       |
| プライベート・エクイティ投資                      | 43,012            | 32,121                      |                       |
| 建物、土地、器具備品および設備                     | 433,106           | 417,896                     |                       |
| トレーディング目的以外の負債証券                    | 431,590           | 441,485                     |                       |
| 投資持分証券                              | 111,388           | 111,388                     |                       |
| 関連会社に対する投資および貸付金                    | 390,054           | 390,621                     |                       |
| その他                                 | 967,353           | 966,808                     |                       |
| 資産の部合計                              | 41,545,394        | 40,428,302                  |                       |
| <b>負債の部</b>                         |                   |                             |                       |
| 短期借入                                | 1,392,377         | 1,235,455                   |                       |
| 顧客に対する支払債務                          | 1,267,014         | 1,267,014                   |                       |
| 顧客以外に対する支払債務                        | 1,205,137         | 1,204,800                   |                       |
| 受入銀行預金                              | 1,105,097         | 1,105,097                   |                       |
| 買戻条件付売却有価証券                         | 14,790,151        | 14,893,342                  |                       |
| 貸付有価証券担保金                           | 1,058,702         | 1,064,700                   |                       |
| その他の担保付借入                           | 363,224           | 363,224                     |                       |
| トレーディング負債                           | 8,679,798         | 8,750,333                   |                       |
| その他の負債                              | 1,019,939         | 1,025,128                   |                       |
| 長期借入                                | 7,833,308         | 7,050,623                   |                       |
| 負債の部合計                              | 38,714,750        | 37,959,721                  |                       |
| <b>純資産の部</b>                        |                   |                             |                       |
| 資本金                                 | 594,492           | 594,492                     | 1a                    |
| 資本剰余金                               | 676,040           | 676,040                     | 1a                    |
| 利益剰余金                               | 1,769,225         | 1,765,824                   | 2                     |
| 累積的その他の包括利益                         | △25,973           | △25,973                     | 3                     |
| 自己株式                                | △234,282          | △234,282                    | 1c                    |
| 非支配持分                               | 51,140            | 51,140                      |                       |
| 純資産の部合計                             | 2,830,643         | 2,827,242                   |                       |
| <b>負債及び純資産の部合計</b>                  | <b>41,545,394</b> | <b>40,786,964</b>           |                       |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係 |               |                             |                               |
|-------------------------------------|---------------|-----------------------------|-------------------------------|
| 項目                                  | イ             | ロ                           | ハ                             |
|                                     | 公表<br>連結貸借対照表 | 規制上の連結範囲<br>に基づく連結貸借<br>対照表 | 別紙様式第一号<br>(自己資本の構成)<br>の参照項目 |
| <b>資産の部</b>                         |               |                             |                               |
| 現金および現金同等物                          | 2,824,181     | 2,798,932                   |                               |
| 定期預金                                | 281,822       | 281,822                     |                               |
| 取引所預託金およびその他の顧客分別金                  | 274,313       | 274,313                     |                               |
| 貸付金                                 | 2,721,107     | 2,747,416                   |                               |
| 顧客に対する受取債権                          | 550,481       | 549,112                     |                               |
| 顧客以外に対する受取債権                        | 889,672       | 886,547                     |                               |
| 貸倒引当金                               | △5,999        | △5,999                      |                               |
| 売戻条件付買入有価証券                         | 14,135,233    | 14,135,233                  |                               |
| 借入有価証券担保金                           | 4,102,425     | 4,102,425                   |                               |
| トレーディング資産                           | 17,576,367    | 16,392,164                  |                               |
| プライベート・エクイティ投資                      | 31,362        | 28,894                      |                               |
| 建物、土地、器具備品および設備                     | 459,166       | 438,648                     |                               |
| トレーディング目的以外の負債証券                    | 467,795       | 470,524                     |                               |
| 投資持分証券                              | 134,214       | 134,214                     |                               |
| 関連会社に対する投資および貸付金                    | 359,399       | 359,966                     |                               |
| その他                                 | 875,562       | 875,275                     |                               |
| 資産の部合計                              | 45,677,106    | 44,469,494                  |                               |
| <b>負債の部</b>                         |               |                             |                               |
| 短期借入                                | 950,061       | 803,859                     |                               |
| 顧客に対する支払債務                          | 1,258,574     | 1,258,574                   |                               |
| 顧客以外に対する支払債務                        | 1,246,412     | 1,246,113                   |                               |
| 受入銀行預金                              | 1,252,142     | 1,252,142                   |                               |
| 買戻条件付売却有価証券                         | 19,068,815    | 19,167,330                  |                               |
| 貸付有価証券担保金                           | 1,092,389     | 1,104,359                   |                               |
| その他の担保付借入                           | 322,001       | 322,001                     |                               |
| トレーディング負債                           | 8,767,595     | 8,811,075                   |                               |
| その他の負債                              | 1,016,300     | 1,038,042                   |                               |
| 長期借入                                | 7,914,636     | 7,052,197                   |                               |
| 負債の部合計                              | 42,888,930    | 42,055,698                  |                               |
| <b>純資産の部</b>                        |               |                             |                               |
| 資本金                                 | 594,492       | 594,492                     | 1a                            |
| 資本剰余金                               | 682,851       | 682,851                     | 1a                            |
| 利益剰余金                               | 1,638,346     | 1,636,353                   | 2                             |
| 累積的其他の包括利益                          | △67,442       | △67,442                     | 3                             |
| 自己株式                                | △140,369      | △140,369                    | 1c                            |
| 非支配持分                               | 80,297        | 80,297                      |                               |
| 純資産の部合計                             | 2,788,175     | 2,786,182                   |                               |
| 負債及び純資産の部合計                         | 45,677,106    | 44,841,880                  |                               |

(注)

イ欄は百万円未満の端数処理の違いにより、有価証券報告書・四半期報告書等における連結貸借対照表上の数値とずれる場合がございます。

### 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（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

リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・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<br>2020年9月末 |
|--|------------------------|
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）      | 6,728                  |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドレート方式）       | -                      |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）      | -                      |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）      | 55,660                 |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%） | 12,347                 |

(単位：百万円)

|  | エクスポージャーの額<br>2019年9月末 |
|--|------------------------|
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）      | 10,056                 |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドレート方式）       | -                      |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）      | -                      |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）      | 41,776                 |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%） | 4,489                  |

### 3. その他定量的な開示事項

#### (1) 主要な指標

KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

| KM1：主要な指標         |                         |            |            |            |            |            |
|-------------------|-------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| 国際様式<br>の該<br>当番号 |                         | イ          | ロ          | ハ          | ニ          | ホ          |
|                   |                         | 2020年9月末   | 2020年6月末   | 2020年3月末   | 2019年12月末  | 2019年9月末   |
| 資本                |                         |            |            |            |            |            |
| 1                 | 普通株式等Tier1資本の額          | 2,537,712  | 2,546,444  | 2,404,634  | 2,534,259  | 2,524,353  |
| 2                 | Tier1資本の額               | 2,855,329  | 2,864,351  | 2,571,500  | 2,701,086  | 2,691,284  |
| 3                 | 総自己資本の額                 | 2,886,385  | 2,895,475  | 2,602,379  | 2,747,178  | 2,737,400  |
| リスク・アセット          |                         |            |            |            |            |            |
| 4                 | リスク・アセットの額              | 15,037,167 | 16,092,669 | 15,674,493 | 14,028,085 | 14,576,989 |
| 自己資本比率            |                         |            |            |            |            |            |
| 5                 | 連結普通株式等Tier1比率          | 16.87%     | 15.82%     | 15.34%     | 18.06%     | 17.31%     |
| 6                 | 連結Tier1比率               | 18.98%     | 17.79%     | 16.40%     | 19.25%     | 18.46%     |
| 7                 | 連結総自己資本比率               | 19.19%     | 17.99%     | 16.60%     | 19.58%     | 18.77%     |
| 資本バッファー           |                         |            |            |            |            |            |
| 8                 | 資本保全バッファー比率             | 2.50%      | 2.50%      | 2.50%      | 2.50%      | 2.50%      |
| 9                 | カウンター・シクリカル・バッ<br>ファー比率 | 0.01%      | 0.01%      | 0.01%      | 0.11%      | 0.12%      |
| 10                | G-SIB/D-SIBバッファー比率      | 0.50%      | 0.50%      | 0.50%      | 0.50%      | 0.50%      |
| 11                | 最低連結資本バッファー比率           | 3.01%      | 3.01%      | 3.01%      | 3.11%      | 3.12%      |
| 12                | 連結資本バッファー比率             | 11.19%     | 9.99%      | 8.60%      | 11.58%     | 10.77%     |
| 連結レバレッジ比率         |                         |            |            |            |            |            |
| 13                | 総エクスポージャーの額             | 48,731,083 | 48,053,426 | 53,135,763 | 55,692,934 | 54,906,506 |
| 14                | 連結レバレッジ比率               | 5.85%      | 5.96%      | 4.83%      | 4.84%      | 4.90%      |

(単位：百万円、%)

| KM1：主要な指標         |                 |                   |                   |                   |                   |                   |
|-------------------|-----------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 国際様式<br>の該<br>当番号 |                 | イ                 | ロ                 | ハ                 | ニ                 | ホ                 |
|                   |                 | 2021年3月期<br>第2四半期 | 2021年3月期<br>第1四半期 | 2020年3月期<br>第4四半期 | 2020年3月期<br>第3四半期 | 2020年3月期<br>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 | 5,888,043         | 4,936,941         | 4,218,005         | 4,100,488         | 3,987,451         |
| 16                | 純資金流出額          | 2,384,486         | 2,348,784         | 2,109,636         | 2,153,762         | 2,076,060         |
| 17                | 連結流動性カバレッジ比率    | 248.4%            | 216.0%            | 201.1%            | 192.3%            | 194.4%            |

## (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    |           |
|                 |  | 2020年9月末   | 2020年6月末   | 2020年9月末  | 2020年6月末  |
| 1               | 信用リスク  | 1,442,683  | 1,332,152  | 119,290   | 109,898   |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 243,181    | 249,776    | 19,454    | 19,982    |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                     | 807,566    | 693,013    | 68,481    | 58,767    |
|                 | 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  | 391,935    | 389,363    | 31,354    | 31,149    |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 3,559,438  | 3,705,362  | 293,532   | 305,291   |
| 5               | うち、SA-CCR適用分                                     | 535,649    | 496,402    | 45,358    | 42,024    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | 1,161,606  | 1,183,492  | 98,504    | 100,360   |
|                 | うち、CVAリスク  | 1,377,588  | 1,498,422  | 110,207   | 119,873   |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 339,502    | 345,165    | 27,160    | 27,613    |
|                 | その他  | 145,091    | 181,879    | 12,302    | 15,419    |
| 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                       | 1,881,909  | 1,871,370  | 159,585   | 158,692   |
| 8               | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）      | 84,100     | 100,125    | 7,131     | 8,490     |
| 9               | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）        | —          | —          | —         | —         |
|                 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）      | —          | 3,827      | —         | 306       |
|                 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）      | 222,643    | 192,203    | 18,877    | 16,294    |
| 10              | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%） | 154,347    | 153,010    | 12,347    | 12,240    |
| 11              | 未決済取引  | 6,049      | 17,586     | 494       | 1,420     |
| 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、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | —          | —          | —         | —         |
| 14              | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | —          | —          | —         | —         |
| 15              | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | —          | —          | —         | —         |
| 16              | マーケット・リスク  | 4,452,722  | 5,586,351  | 356,217   | 446,908   |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                      | 700,344    | 592,851    | 56,027    | 47,428    |
| 18              | うち、内部モデル方式適用分                                    | 3,752,378  | 4,993,500  | 300,190   | 399,480   |
| 19              | オペレーショナル・リスク                                     | 2,578,119  | 2,490,490  | 206,249   | 199,239   |
| 20              | うち、基礎的手法適用分                                      | —          | —          | —         | —         |
| 21              | うち、粗利益配分手法適用分                                    | 2,578,119  | 2,490,490  | 206,249   | 199,239   |
| 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                 | 344,887    | 337,642    | 29,246    | 28,632    |
|                 | 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)                              | 15,037,167 | 16,092,669 | 1,202,973 | 1,287,413 |

(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    |           |
|                 |  | 2020年9月末   | 2019年9月末   | 2020年9月末  | 2019年9月末  |
| 1               | 信用リスク  | 1,442,683  | 1,400,555  | 119,290   | 115,252   |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 243,181    | 347,517    | 19,454    | 27,801    |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                     | 807,566    | 668,374    | 68,481    | 56,678    |
|                 | 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  | 391,935    | 384,664    | 31,354    | 30,773    |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 3,559,438  | 3,142,752  | 293,532   | 260,480   |
| 5               | うち、SA-CCR適用分                                     | 535,649    | 545,952    | 45,358    | 46,138    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | 1,161,606  | 1,206,259  | 98,504    | 102,290   |
|                 | うち、CVAリスク  | 1,377,588  | 926,192    | 110,207   | 74,095    |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 339,502    | 295,212    | 27,160    | 23,616    |
|                 | その他  | 145,091    | 169,136    | 12,302    | 14,338    |
| 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                       | 1,881,909  | 1,497,782  | 159,585   | 127,011   |
| 8               | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）      | 84,100     | 110,041    | 7,131     | 9,331     |
| 9               | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）        | —          | —          | —         | —         |
|                 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）      | —          | —          | —         | —         |
|                 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）      | 222,643    | 167,104    | 18,877    | 14,164    |
| 10              | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%） | 154,347    | 56,114     | 12,347    | 4,489     |
| 11              | 未決済取引  | 6,049      | 11,254     | 494       | 924       |
| 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、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | —          | —          | —         | —         |
| 14              | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | —          | —          | —         | —         |
| 15              | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | —          | —          | —         | —         |
| 16              | マーケット・リスク  | 4,452,722  | 4,890,305  | 356,217   | 391,224   |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                      | 700,344    | 1,091,715  | 56,027    | 87,337    |
| 18              | うち、内部モデル方式適用分                                    | 3,752,378  | 3,798,589  | 300,190   | 303,887   |
| 19              | オペレーショナル・リスク                                     | 2,578,119  | 2,565,722  | 206,249   | 205,257   |
| 20              | うち、基礎的手法適用分                                      | —          | —          | —         | —         |
| 21              | うち、粗利益配分手法適用分                                    | 2,578,119  | 2,565,722  | 206,249   | 205,257   |
| 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                 | 344,887    | 448,368    | 29,246    | 38,021    |
|                 | 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)                              | 15,037,167 | 14,576,989 | 1,202,973 | 1,166,159 |

(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

2020年9月末

(単位：百万円)

| CR1：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<br>(イ+ローハ) |
|               |                                | デフォルトした<br>エクスポージャー | 非デフォルト<br>エクスポージャー |     |                  |
| オン・バランスシートの資産 |                                |                     |                    |     |                  |
| 1             | 貸出金                            | -                   | 595,443            | -   | 595,443          |
| 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<br>資産（うち負債性のもの） | -                   | -                  | -   | -                |
| 4             | オン・バランスシートの資産の<br>合計（1+2+3）    | -                   | 595,443            | -   | 595,443          |
| オフ・バランスシートの資産 |                                |                     |                    |     |                  |
| 5             | 支払承諾等                          | -                   | 14,592             | -   | 14,592           |
| 6             | コミットメント等                       | -                   | 72,621             | -   | 72,621           |
| 7             | オフ・バランスシートの資産の<br>合計（5+6）      | -                   | 87,214             | -   | 87,214           |
| 合計            |                                |                     |                    |     |                  |
| 8             | 合計（4+7）                        | -                   | 682,658            | -   | 682,658          |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CR1：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<br>(イ+ローハ) |
|               |                                | デフォルトした<br>エクスポージャー | 非デフォルト<br>エクスポージャー |     |                  |
| オン・バランスシートの資産 |                                |                     |                    |     |                  |
| 1             | 貸出金                            | 4,592               | 561,093            | -   | 565,686          |
| 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<br>資産（うち負債性のもの） | -                   | -                  | -   | -                |
| 4             | オン・バランスシートの資産の<br>合計（1+2+3）    | 4,592               | 561,093            | -   | 565,686          |
| オフ・バランスシートの資産 |                                |                     |                    |     |                  |
| 5             | 支払承諾等                          | -                   | 5,632              | -   | 5,632            |
| 6             | コミットメント等                       | -                   | 77,636             | -   | 77,636           |
| 7             | オフ・バランスシートの資産の<br>合計（5+6）      | -                   | 83,268             | -   | 83,268           |
| 合計            |                                |                     |                    |     |                  |
| 8             | 合計（4+7）                        | 4,592               | 644,362            | -   | 648,954          |

(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

2020年9月末

(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          | 352            |     |
| 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       | -   |
| 3                                    |   | 非デフォルト状態へ復帰した額 | -   |
| 4                                    |   | 償却された額         | 352 |
| 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） | -              |     |

## CR3：信用リスク削減手法

2020年9月末

(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<br>エクスポ<br>ージャー | 保全された<br>エクスポ<br>ージャー | 担保で<br>保全された<br>エクスポ<br>ージャー | 保証で<br>保全された<br>エクスポ<br>ージャー | クレジット・<br>デリバティブ<br>で保全された<br>エクスポ<br>ージャー |
| 1             | 貸出金                      | 252,023             | 343,420               | 343,420                      | -                            | -  |
| 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）                | 252,023             | 343,420               | 343,420                      | -                            | -  |
| 5             | うちデフォルトしたもの              | -                   | -                     | -                            | -                            | -  |

2019年9月末

(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<br>エクスポ<br>ージャー | 保全された<br>エクスポ<br>ージャー | 担保で<br>保全された<br>エクスポ<br>ージャー | 保証で<br>保全された<br>エクスポ<br>ージャー | クレジット・<br>デリバティブ<br>で保全された<br>エクスポ<br>ージャー |
| 1             | 貸出金                      | 249,601             | 316,084               | 316,084                      | -                            | -  |
| 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）                | 249,601             | 316,084               | 316,084                      | -                            | -  |
| 5             | うちデフォルトしたもの              | 4,592               | -                     | -                            | -                            | -  |

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

2020年9月末

(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                                    | 資産クラス                  | 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          | 1,622                     | -            | 1,622                     | -            | 0            | 0.00%                        |
| 3                                     | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 4,175                     | -            | 4,175                     | -            | 1,087        | 26.04%                       |
| 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      | 1                         | -            | 1                         | -            | 0            | 20.00%                       |
| 7                                     | 国際開発銀行向け               | -                         | -            | -                         | -            | -            | -                            |
| 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           | 0                         | -            | 0                         | -            | 0            | 10.00%                       |
| 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    | 29,710                    | -            | 29,710                    | -            | 8,126        | 27.35%                       |
| 12                                    | 法人等向け                  | 576,078                   | -            | 232,657                   | -            | 232,002      | 99.71%                       |
| 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             | 3                         | -            | 3                         | -            | 3            | 100.00%                      |
| 16                                    | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | 1,307                     | -            | 1,307                     | -            | 1,961        | 149.99%                      |
| 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                     | 612,900                   | -            | 269,480                   | -            | 243,181      | 90.24%                       |

2019年9月末

(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                                    | 資産クラス                  | 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                | オフ・バランスシート | オン・バランスシート                | オフ・バランスシート |              |   |                              |   |         |   |   |   |
| 1                                     | 現金                     | -                         | -          | -                         | -          | -            | - | -                            | - | -       | - | - | - |
| 2                                     | 日本国政府及び日本銀行向け          | 33,660                    | -          | 33,660                    | -          | -            | - | 0                            | - | 0.00%   | - | - |   |
| 3                                     | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 3,281                     | -          | 3,281                     | -          | -            | - | 1,052                        | - | 32.05%  | - | - |   |
| 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      | 17                        | -          | 17                        | -          | -            | - | 3                            | - | 20.00%  | - | - |   |
| 7                                     | 国際開発銀行向け               | 2                         | -          | 2                         | -          | -            | - | -                            | - | -       | - | - |   |
| 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           | 0                         | -          | 0                         | -          | -            | - | 0                            | - | 10.00%  | - | - |   |
| 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    | 57,508                    | -          | 57,508                    | -          | -            | - | 22,171                       | - | 38.55%  | - | - |   |
| 12                                    | 法人等向け                  | 634,353                   | -          | 318,269                   | -          | -            | - | 317,218                      | - | 99.66%  | - | - |   |
| 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             | -                         | -          | -                         | -          | -            | - | -                            | - | -       | - | - |   |
| 16                                    | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | 4,714                     | -          | 4,714                     | -          | -            | - | 7,071                        | - | 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                     | 733,540                   | -          | 417,455                   | -          | -            | - | 347,517                      | - | 83.24%  | - | - |   |

## 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

2020年9月末

(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<br>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          | 1,622                               | -   | -      | -   | -     | -   | -       | -     | -    | -     | 1,622   |
| 3   | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 1,970                               | -   | 49     | -   | 2,155 | -   | -       | -     | -    | -     | 4,175   |
| 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      | -                                   | -   | 1      | -   | -     | -   | -       | -     | -    | -     | 1       |
| 7   | 国際開発銀行向け               | -                                   | -   | -      | -   | -     | -   | -       | -     | -    | -     | -       |
| 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           | -                                   | 0   | -      | -   | -     | -   | -       | -     | -    | -     | 0       |
| 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    | -                                   | -   | 24,420 | -   | 4,096 | -   | 1,194   | -     | -    | -     | 29,710  |
| 12  | 法人等向け                  | -                                   | -   | 695    | -   | 198   | -   | 231,764 | -     | -    | -     | 232,657 |
| 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             | -                                   | -   | -      | -   | -     | -   | 3       | -     | -    | -     | 3       |
| 16  | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | -                                   | -   | -      | -   | -     | -   | -       | 1,307 | -    | -     | 1,307   |
| 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                     | 3,593                               | 0   | 25,167 | -   | 6,449 | -   | 232,961 | 1,307 | -    | -     | 269,480 |

2019年9月末

(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<br>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          | 33,660                              | -   | -      | -   | -      | -   | -       | -     | -    | -     | 33,660  |
| 3   | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 898                                 | -   | 465    | -   | 1,917  | -   | -       | -     | -    | -     | 3,281   |
| 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      | -                                   | -   | 17     | -   | -      | -   | -       | -     | -    | -     | 17      |
| 7   | 国際開発銀行向け               | 2                                   | -   | -      | -   | -      | -   | -       | -     | -    | -     | 2       |
| 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           | -                                   | -   | -      | -   | -      | -   | -       | -     | -    | -     | -       |
| 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    | -                                   | -   | 25,287 | -   | 30,214 | -   | 2,006   | -     | -    | -     | 57,508  |
| 12  | 法人等向け                  | -                                   | -   | 1,022  | -   | 463    | -   | 316,782 | -     | -    | -     | 318,269 |
| 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             | -                                   | -   | -      | -   | -      | -   | -       | -     | -    | -     | -       |
| 16  | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | -                                   | -   | -      | -   | -      | -   | -       | 4,714 | -    | -     | 4,714   |
| 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                     | 34,561                              | -   | 26,793 | -   | 32,596 | -   | 318,788 | 4,714 | -    | -     | 417,455 |

CR6：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

2020年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6：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 |                 |                          |  |         |                     |         |        |        |        |              |                              |        |       |
|--|-----------------|--------------------------|--|---------|---------------------|---------|--------|--------|--------|--------------|------------------------------|--------|-------|
| 項番   | PD区分            | イ                        | ロ                                      | ハ       | ニ                   | ホ       | ヘ      | ト      | チ      | リ            | ヌ                            | ル      | ヲ     |
|  |                 | 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    | 3,108,659                | -                                      | -       | 3,108,659           | 0.00%   | 100件未満 | 45.00% | 1.1    | 57           | 0.00%                        | 0      |       |
| 2  | 0.15以上0.25未満    | -                        | -                                      | -       | -                   | -       | -      | -      | -      | -            | -                            | 0      |       |
| 3  | 0.25以上0.50未満    | 796                      | -                                      | -       | 796                 | 0.32%   | 100件未満 | 45.00% | 2.8    | 478          | 60.06%                       | 1      |       |
| 4  | 0.50以上0.75未満    | 164                      | -                                      | -       | 164                 | 0.61%   | 100件未満 | 45.00% | 1.0    | 95           | 57.94%                       | 0      |       |
| 5  | 0.75以上2.50未満    | -                        | -                                      | -       | -                   | -       | -      | -      | -      | -            | -                            | 0      |       |
| 6  | 2.50以上10.00未満   | 5                        | -                                      | -       | 5                   | 8.60%   | 100件未満 | 45.00% | 1.0    | 9            | 165.04%                      | -      |       |
| 7  | 10.00以上100.00未満 | 40                       | -                                      | -       | 40                  | 27.71%  | 100件未満 | 45.00% | 1.0    | 96           | 235.17%                      | 5      |       |
| 8  | 100.00 (デフォルト)  | -                        | -                                      | -       | -                   | -       | -      | -      | -      | -            | -                            | -      |       |
| 9  | 小計              | 3,109,667                | -                                      | -       | 3,109,667           | 0.00%   | 100件未満 | 45.00% | 1.1    | 737          | 0.02%                        | 6      | -     |
| 金融機関等向けエクスポージャー                                  |                 |                          |  |         |                     |         |        |        |        |              |                              |        |       |
| 1  | 0.00以上0.15未満    | 1,257,451                | -                                      | -       | 1,257,451           | 0.05%   | 0.2    | 45.00% | 1.4    | 236,563      | 18.81%                       | 291    |       |
| 2  | 0.15以上0.25未満    | 15,394                   | -                                      | -       | 15,394              | 0.19%   | 100件未満 | 45.00% | 2.8    | 7,207        | 46.81%                       | 13     |       |
| 3  | 0.25以上0.50未満    | 33,981                   | -                                      | -       | 33,981              | 0.29%   | 100件未満 | 45.00% | 1.1    | 17,067       | 50.22%                       | 45     |       |
| 4  | 0.50以上0.75未満    | 62,245                   | -                                      | -       | 62,245              | 0.61%   | 100件未満 | 45.00% | 1.0    | 36,264       | 58.25%                       | 170    |       |
| 5  | 0.75以上2.50未満    | 4,678                    | -                                      | -       | 4,678               | 0.93%   | 100件未満 | 45.00% | 1.0    | 3,368        | 71.99%                       | 19     |       |
| 6  | 2.50以上10.00未満   | 2,634                    | -                                      | -       | 2,634               | 4.26%   | 100件未満 | 45.00% | 2.1    | 3,673        | 139.45%                      | 50     |       |
| 7  | 10.00以上100.00未満 | 3,750                    | -                                      | -       | 3,750               | 27.71%  | 100件未満 | 45.00% | 1.7    | 9,089        | 242.34%                      | 467    |       |
| 8  | 100.00 (デフォルト)  | -                        | -                                      | -       | -                   | -       | -      | -      | -      | -            | -                            | -      |       |
| 9  | 小計              | 1,380,137                | -                                      | -       | 1,380,137           | 0.17%   | 0.3    | 45.00% | 1.4    | 313,234      | 22.69%                       | 1,059  | -     |
| 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    | 80,498                   | -                                      | -       | 80,498              | 0.04%   | 0.3    | 45.00% | 1.7    | 14,947       | 18.56%                       | 15     |       |
| 2  | 0.15以上0.25未満    | 9,376                    | -                                      | -       | 9,376               | 0.19%   | 100件未満 | 45.00% | 4.7    | 7,793        | 83.11%                       | 8      |       |
| 3  | 0.25以上0.50未満    | 13,847                   | -                                      | -       | 13,847              | 0.36%   | 100件未満 | 45.00% | 2.6    | 11,035       | 79.69%                       | 22     |       |
| 4  | 0.50以上0.75未満    | 42                       | -                                      | -       | 42                  | 0.61%   | 100件未満 | 45.00% | 2.6    | 38           | 90.46%                       | -      |       |
| 5  | 0.75以上2.50未満    | 813                      | -                                      | -       | 813                 | 1.43%   | 100件未満 | 45.00% | 2.6    | 923          | 113.47%                      | 5      |       |
| 6  | 2.50以上10.00未満   | 1,030                    | -                                      | -       | 1,030               | 5.02%   | 100件未満 | 45.00% | 4.7    | 1,890        | 183.41%                      | 23     |       |
| 7  | 10.00以上100.00未満 | 74,607                   | 14,592                                 | 100.00% | 89,200              | 27.71%  | 1.1    | 45.00% | 2.3    | 244,250      | 273.82%                      | 11,124 |       |
| 8  | 100.00 (デフォルト)  | 1,159                    | -                                      | -       | 1,159               | 100.00% | 100件未満 | 45.00% | 1.0    | -            | -                            | 521    |       |
| 9  | 小計              | 181,377                  | 14,592                                 | 100.00% | 195,970             | 13.29%  | 1.6    | 45.00% | 2.2    | 280,879      | 143.32%                      | 11,721 | -     |
| 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              | -                        | -                                      | -       | -                   | -       | -      | -      | -      | -            | -                            | -      | -     |

| CR6：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 |                 |  |  |       |                                 |      |           |       |            |                          |  |    |           |
|--|-----------------|--|--|-------|---------------------------------|------|-----------|-------|------------|--------------------------|--|----|-----------|
| 項番   | PD区分            | イ  | ロ  | ハ     | ニ                               | ホ    | ヘ         | ト     | チ          | リ                        | ヌ  | ル  | ヲ         |
|  |                 | オン・バ<br>ランス<br>シート・<br>グロスエ<br>クスポー<br>ジャーの<br>額 | CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用前のオ<br>フ・バラ<br>ンスシー<br>ト・エク<br>スポー<br>ジャーの<br>額 | 平均CCF | CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用後EAD | 平均PD | 債務者の<br>数 | 平均LGD | 平均残存<br>期間 | 信用リス<br>ク・ア<br>セットの<br>額 | リスク・<br>ウエイト<br>の加重平<br>均値（RWA<br>density） | EL | 適格<br>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              | -  | -  | -     | -                               | -    | -         | -     | -          | -                        | -  | -  | -         |

| CR6：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・ウエイトの加重平均値（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）                                   |                 | 4,671,182                | 14,592                                 | 100.00% | 4,685,774           | 0.60% | 2.0   | 45.00% | 1.2    | 594,850      | 12.69%                      | 12,787 | -     |

| CR6：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 |                 |  |  |         |                                 |         |           |        |            |                          |  |       |           |
|--|-----------------|--|--|---------|---------------------------------|---------|-----------|--------|------------|--------------------------|--|-------|-----------|
| 項番   | PD区分            | イ  | ロ  | ハ       | ニ                               | ホ       | ヘ         | ト      | チ          | リ                        | ヌ  | ル     | ヲ         |
|  |                 | オン・バ<br>ランス<br>シート・<br>グロスエ<br>クスポー<br>ジャーの<br>額 | CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用前のオ<br>フ・バラ<br>ンスシー<br>ト・エク<br>スポー<br>ジャーの<br>額 | 平均CCF   | CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用後EAD | 平均PD    | 債務者の<br>数 | 平均LGD  | 平均残存<br>期間 | 信用リス<br>ク・ア<br>セットの<br>額 | リスク・<br>ウエイト<br>の加重平<br>均値（RWA<br>density） | EL    | 適格<br>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    | 1,621,104  | -  | -       | 1,621,104                       | 0.00%   | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | 14                       | 0.00%                                      | 0     |           |
| 2  | 0.15以上0.25未満    | 5  | -  | -       | 5                               | 0.20%   | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | 1                        | 30.22%                                     | 0     |           |
| 3  | 0.25以上0.50未満    | 548  | -  | -       | 548                             | 0.29%   | 100件未満    | 45.00% | 3.1        | 336                      | 61.45%                                     | 0     |           |
| 4  | 0.50以上0.75未満    | 15   | -  | -       | 15                              | 0.63%   | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | 9                        | 58.96%                                     | 0     |           |
| 5  | 0.75以上2.50未満    | 8  | -  | -       | 8                               | 1.97%   | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | 8                        | 95.35%                                     | 0     |           |
| 6  | 2.50以上10.00未満   | -  | -  | -       | -                               | -       | -         | -      | -          | -                        | -  | -     |           |
| 7  | 10.00以上100.00未満 | 3,653  | -  | -       | 3,653                           | 27.47%  | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | 8,585                    | 235.02%                                    | 451   |           |
| 8  | 100.00（デフォルト）   | 8  | -  | -       | 8                               | 100.00% | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | -                        | -  | 4     |           |
| 9  | 小計              | 1,625,343  | -  | -       | 1,625,343                       | 0.06%   | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | 8,956                    | 0.55%                                      | 456   | -         |
| 金融機関等向けエクスポージャー                                  |                 |  |  |         |                                 |         |           |        |            |                          |  |       |           |
| 1  | 0.00以上0.15未満    | 1,432,870  | -  | -       | 1,432,870                       | 0.05%   | 0.1       | 45.00% | 1.0        | 223,978                  | 15.63%                                     | 327   |           |
| 2  | 0.15以上0.25未満    | 61,675   | -  | -       | 61,675                          | 0.20%   | 100件未満    | 45.00% | 1.1        | 19,881                   | 32.23%                                     | 56    |           |
| 3  | 0.25以上0.50未満    | 50,269   | -  | -       | 50,269                          | 0.30%   | 100件未満    | 45.00% | 1.1        | 23,352                   | 46.45%                                     | 68    |           |
| 4  | 0.50以上0.75未満    | 5,798  | -  | -       | 5,798                           | 0.63%   | 100件未満    | 45.00% | 2.3        | 5,037                    | 86.88%                                     | 16    |           |
| 5  | 0.75以上2.50未満    | 515  | -  | -       | 515                             | 1.73%   | 100件未満    | 45.00% | 1.3        | 574                      | 111.32%                                    | 4     |           |
| 6  | 2.50以上10.00未満   | 154  | -  | -       | 154                             | 5.40%   | 100件未満    | 45.00% | 4.3        | 271                      | 176.47%                                    | 3     |           |
| 7  | 10.00以上100.00未満 | 2,846  | -  | -       | 2,846                           | 27.47%  | 100件未満    | 45.00% | 2.2        | 7,018                    | 246.57%                                    | 351   |           |
| 8  | 100.00（デフォルト）   | -  | -  | -       | -                               | -       | -         | -      | -          | -                        | -  | -     |           |
| 9  | 小計              | 1,554,129  | -  | -       | 1,554,129                       | 0.11%   | 0.3       | 45.00% | 1.0        | 280,114                  | 18.02%                                     | 827   | -         |
| 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    | 90,824   | 56   | 100.00% | 90,880                          | 0.03%   | 0.2       | 45.00% | 2.2        | 18,498                   | 20.35%                                     | 16    |           |
| 2  | 0.15以上0.25未満    | 2,453  | -  | -       | 2,453                           | 0.20%   | 100件未満    | 45.00% | 4.1        | 1,766                    | 71.99%                                     | 2     |           |
| 3  | 0.25以上0.50未満    | 5,774  | -  | -       | 5,774                           | 0.39%   | 100件未満    | 45.00% | 1.9        | 3,610                    | 62.51%                                     | 10    |           |
| 4  | 0.50以上0.75未満    | 191  | 3,342  | 100.00% | 3,534                           | 0.63%   | 100件未満    | 45.00% | 4.9        | 3,829                    | 108.34%                                    | 10    |           |
| 5  | 0.75以上2.50未満    | 487  | -  | -       | 487                             | 1.90%   | 100件未満    | 45.00% | 4.5        | 836                      | 171.48%                                    | 4     |           |
| 6  | 2.50以上10.00未満   | 3,470  | 627  | 100.00% | 4,098                           | 9.02%   | 100件未満    | 45.00% | 4.9        | 8,786                    | 214.38%                                    | 166   |           |
| 7  | 10.00以上100.00未満 | 59,028   | 1,905  | 96.06%  | 60,859                          | 27.47%  | 0.8       | 45.00% | 1.8        | 161,648                  | 265.61%                                    | 7,524 |           |
| 8  | 100.00（デフォルト）   | 276  | -  | -       | 276                             | 100.00% | 100件未満    | 45.00% | 1.0        | -                        | -  | 124   |           |
| 9  | 小計              | 162,507  | 5,932  | 98.73%  | 168,364                         | 10.37%  | 1.1       | 45.00% | 2.2        | 198,976                  | 118.18%                                    | 7,858 | -         |
| 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              | -  | -  | -       | -                               | -       | -         | -      | -          | -                        | -  | -     | -         |

| 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<br>ランス<br>シート・<br>グロスエ<br>クスポー<br>ジャーの<br>額 | CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用前のオ<br>フ・バラ<br>ンスシー<br>ト・エク<br>スポー<br>ジャーの<br>額 | 平均CCF | CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用後EAD | 平均PD | 債務者の<br>数 | 平均LGD | 平均残存<br>期間 | 信用リス<br>ク・ア<br>セットの<br>額 | リスク・<br>ウエイト<br>の加重平<br>均値 (RWA<br>density) | EL | 適格<br>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              | -  | -  | -     | -                               | -    | -         | -     | -          | -                        | -   | -  | -         |

| CR6：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 |                 |   |   |            |                                      |           |                |            |                 |                               |   |         |                |
|--|-----------------|---|---|------------|--------------------------------------|-----------|----------------|------------|-----------------|-------------------------------|---|---------|----------------|
| 項番   | PD区分            | イ<br>オン・バ<br>ランス<br>シート・<br>グロスエ<br>クスポー<br>ジャーの<br>額 | ロ<br>CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用前のオ<br>フ・バラ<br>ンスシー<br>ト・エク<br>スポー<br>ジャーの<br>額 | ハ<br>平均CCF | ニ<br>CCF・信用<br>リスク削<br>減手法適<br>用後EAD | ホ<br>平均PD | ヘ<br>債務者の<br>数 | ト<br>平均LGD | チ<br>平均残存<br>期間 | リ<br>信用リス<br>ク・ア<br>セットの<br>額 | ヌ<br>リスク・<br>ウエイト<br>の加重平<br>均値（RWA<br>density） | ル<br>EL | ヲ<br>適格<br>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）  | 3,341,980   | 5,932   | 98.73%     | 3,347,838                            | 0.60%     | 1.5            | 45.00%     | 1.1             | 488,046                       | 14.57%  | 9,142   | -              |

(注)

へ欄「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。

CR7：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

2020年9月末

(単位：百万円)

| CR7：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<br>勘案前の信用リスク・<br>アセットの額 | 実際の信用リスク・<br>アセットの額 |
| 1   | ソブリン向けエクスポージャー－FIRB             | 737                                  | 737                 |
| 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            | 313,234                              | 313,234             |
| 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 | 280,879                              | 280,879             |
| 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                              | 594,850                              | 594,850             |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CR7：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<br>勘案前の信用リスク・<br>アセットの額 | 実際の信用リスク・<br>アセットの額 |
| 1   | ソブリン向けエクスポージャー－FIRB             | 8,956                                | 8,956               |
| 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            | 280,114                              | 280,114             |
| 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 | 198,976                              | 198,976             |
| 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                              | 488,046                              | 488,046             |

## 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)

| 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 |                                   |                                   |           |
|---|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|
| 項番  |                                   | 信用リスク・アセットの額                      |           |
| 1   | 前四半期末時点（2020年6月末）における信用リスク・アセットの額 | 3,249,992                         |           |
| 2   | 当四半期中の要因別の変動額                     | 資産の規模                             | 137,233   |
| 3   |                                   | ポートフォリオの質                         | 13,918    |
| 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                             | △5,526    |
| 8   |                                   | その他                               | —         |
| 9   |                                   | 当四半期末時点（2020年9月末）における信用リスク・アセットの額 | 3,395,617 |

(注)

モデルの更新により格付区分に変更のあった債務者の変動額はすべて項番4「モデルの更新」に含めております。また、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）

2020年9月末

(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       | 13,311       | 3,791        | 50.00%          | 6,748           | -  | -  | 9,407  | 16,155  | 8,077        | -         |  |  |  |  |  |
|   | 2.5年以上       | 44,803       | 13,038       | 70.00%          | 54,582          | -  | -  | -      | 54,582  | 38,207       | 218       |  |  |  |  |  |
| 良（Good）   | 2.5年未満       | 32,592       | 3,165        | 70.00%          | 3,633           | -  | -  | 31,333 | 34,966  | 24,476       | 139       |  |  |  |  |  |
|   | 2.5年以上       | 67,637       | 52,137       | 90.00%          | 70,029          | -  | -  | 36,711 | 106,740 | 96,066       | 853       |  |  |  |  |  |
| 可（Satisfactory）   |              | 22,501       | 65           | 115.00%         | 10,626          | -  | -  | 11,924 | 22,550  | 25,933       | 631       |  |  |  |  |  |
| 弱い（Weak）  |              | 7,664        | 423          | 250.00%         | -               | -  | -  | 7,981  | 7,981   | 19,953       | 638       |  |  |  |  |  |
| デフォルト（Default）  |              | -            | -            | -               | -               | -  | -  | -      | -       | -            | -         |  |  |  |  |  |
| 合計  |              | 188,510      | 72,621       | -               | 145,619         | -  | -  | 97,357 | 242,976 | 212,715      | 2,482     |  |  |  |  |  |
| 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 | 期待損失      |  |  |  |  |  |
| 簡易手法－上場株式   | 443,492      | -            | 300.00%      | /               |                 |    |    |        |         | 443,492      | 1,330,478 |  |  |  |  |  |
| 簡易手法－非上場株式  | 137,857      | -            | 400.00%      |                 |                 |    |    |        | 137,857 | 551,430      |           |  |  |  |  |  |
| 内部モデル手法   | -            | -            | -            |                 |                 |    |    |        | -       | -            |           |  |  |  |  |  |
| 合計  | 581,350      | -            | -            |                 |                 |    |    |        | 581,350 | 1,881,909    |           |  |  |  |  |  |
| 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%      | /               |                 |    |    |        | -       | -            |           |  |  |  |  |  |

| CR10：内部格付手法－特定貸付債権（スロッシング・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（スロッシング・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・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト | エクスポージャーの額（EAD） |    |    |         |                  | 信用リスク・<br>アセットの額 | 期待損失  |
|   |                      |                      |                      |              | PF              | OF | CF | IPRE    | 合計               |                  |       |
| 優（Strong）   | 2.5年未満               | 42,186               | 19,310               | 50.00%       | 24,186          | -  | -  | 32,483  | 56,669           | 28,334           | -     |
|   | 2.5年以上               | 47,486               | 955                  | 70.00%       | 38,019          | -  | -  | 10,183  | 48,203           | 33,742           | 192   |
| 良（Good）   | 2.5年未満               | 44,199               | -                    | 70.00%       | 16,130          | -  | -  | 28,068  | 44,199           | 30,939           | 176   |
|   | 2.5年以上               | 48,050               | 57,001               | 90.00%       | 54,824          | -  | -  | 35,977  | 90,802           | 81,721           | 726   |
| 可（Satisfactory）   |                      | 2,944                | 67                   | 115.00%      | 2,995           | -  | -  | -       | 2,995            | 3,444            | 83    |
| 弱い（Weak）  |                      | 857                  | -                    | 250.00%      | -               | -  | -  | 857     | 857              | 2,143            | 68    |
| デフォルト（Default）  |                      | 4,218                | -                    | -            | -               | -  | -  | 4,218   | 4,218            | -                | 2,109 |
| 合計  |                      | 189,943              | 77,336               | -            | 136,156         | -  | -  | 111,789 | 247,945          | 180,327          | 3,357 |
| 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・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト | /               |    |    |         |                  | 信用リスク・<br>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・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト         | /            |                 |    |    |         | 信用リスク・<br>アセットの額 | 期待損失             |       |
| 簡易手法－上場株式   | 406,916              | -                    | 300.00%              | /            |                 |    |    |         | 406,916          | 1,220,750        |       |
| 簡易手法－非上場株式  | 69,258               | -                    | 400.00%              | /            |                 |    |    |         | 69,258           | 277,032          |       |
| 内部モデル手法   | -                    | -                    | -                    | /            |                 |    |    |         | -                | -                |       |
| 合計  | 476,174              | -                    | -                    | /            |                 |    |    |         | 476,174          | 1,497,782        |       |
| 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四百十三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

## CCR1：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

2020年9月末

(単位：百万円)

| CCR1：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          |
|                                   |                    | RC      | PFE     | 実効EPE     | 規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$ | 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             | 129,143 | 428,646 |           | 1.4                            | 871,995               | 535,649    |
| 2                                 | 期待エクスポージャー方式       |         |         | 3,413,184 | 1.4                            | 4,785,184             | 1,161,606  |
| 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 |         |         |           |                                | 1,932,263             | 145,091    |
| 5                                 | エクスポージャー変動推計モデル    |         |         |           |                                | -                     | -          |
| 6                                 | 合計                 |         |         |           |                                |                       | 1,842,347  |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CCR1：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 $\alpha$ | 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             | 183,353 | 517,757 |           | 1.4                            | 1,052,634             | 545,952    |
| 2                                 | 期待エクスポージャー方式       |         |         | 3,404,729 | 1.4                            | 4,855,076             | 1,206,259  |
| 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 |         |         |           |                                | 1,999,323             | 169,136    |
| 5                                 | エクスポージャー変動推計モデル    |         |         |           |                                | -                     | -          |
| 6                                 | 合計                 |         |         |           |                                |                       | 1,921,348  |

## CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

2020年9月末

(単位：百万円)

| CCR2：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<br>適用後のエクスポ<br>ージャー | リスク・アセットの額<br>(CVAリスク相当額を<br>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          | 2,993,820                     | 1,084,157                               |
| 2                   | (i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)       |                               | 642,044                                 |
| 3                   | (ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後) |                               | 442,112                                 |
| 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          | 871,995                       | 293,430                                 |
| 5                   | CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計           | 3,865,815                     | 1,377,588                               |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CCR2：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<br>適用後のエクスポ<br>ージャー | リスク・アセットの額<br>(CVAリスク相当額を<br>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          | 3,041,736                     | 638,192                                 |
| 2                   | (i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)       |                               | 132,077                                 |
| 3                   | (ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後) |                               | 506,115                                 |
| 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          | 1,052,634                     | 287,999                                 |
| 5                   | CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計           | 4,094,371                     | 926,192                                 |

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

2020年9月末

(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<br>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     | 61                  | -   | 31,226 | -   | -   | -     | -    | -   | 31,288 |
| 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 | -                   | -   | 9,801  | 165 | -   | 20    | -    | -   | 9,987  |
| 11  | 法人等向け               | -                   | -   | -      | -   | -   | 5,497 | -    | -   | 5,497  |
| 12  | 中小企業等向け及び個人向け       | -                   | -   | -      | -   | -   | -     | -    | -   | -      |
| 13  | 上記以外                | -                   | -   | -      | -   | -   | -     | -    | -   | -      |
| 14  | 合計                  | 61                  | -   | 41,027 | 165 | -   | 5,517 | -    | -   | 46,773 |

2019年9月末

(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<br>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     | -                   | -   | 123,154 | -   | -   | -     | -    | -   | 123,154 |
| 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 | -                   | -   | 8,024   | 36  | -   | 2     | -    | -   | 8,063   |
| 11  | 法人等向け               | -                   | -   | -       | -   | -   | 7,597 | -    | -   | 7,597   |
| 12  | 中小企業等向け及び個人向け       | -                   | -   | -       | -   | -   | -     | -    | -   | -       |
| 13  | 上記以外                | -                   | -   | -       | -   | -   | -     | -    | -   | -       |
| 14  | 合計                  | -                   | -   | 131,178 | 36  | -   | 7,600 | -    | -   | 138,815 |

CCR4：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

2020年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

| CCR4：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  | PD区分            | イ                             | ロ       | ハ           | ニ      | ホ      | ヘ              | ト                                       |
|   |                 | EAD<br>(信用リスク<br>削減効果勘案<br>後) | 平均PD    | 取引相手方の<br>数 | 平均LGD  | 平均残存期間 | 信用リスク・<br>アセット | リスク・ウェ<br>イトの加重平<br>均値 (RWA<br>density) |
| ソブリン向けエクスポージャー                                      |                 |                               |         |             |        |        |                |   |
| 1   | 0.00以上0.15未満    | 1,082,538                     | 0.02%   | 0.1         | 44.21% | 0.5    | 34,619         | 3.19%                                   |
| 2   | 0.15以上0.25未満    | 5,911                         | 0.19%   | 100件未満      | 45.00% | 1.0    | 1,782          | 30.15%                                  |
| 3   | 0.25以上0.50未満    | 27,931                        | 0.29%   | 100件未満      | 45.00% | 0.8    | 10,282         | 36.81%                                  |
| 4   | 0.50以上0.75未満    | 3,505                         | 0.61%   | 100件未満      | 45.00% | 0.0    | 1,795          | 51.22%                                  |
| 5   | 0.75以上2.50未満    | 41,507                        | 1.89%   | 100件未満      | 45.00% | 0.9    | 38,978         | 93.90%                                  |
| 6   | 2.50以上10.00未満   | -                             | -       | -           | -      | -      | -              | -                                       |
| 7   | 10.00以上100.00未満 | 1,513                         | 27.71%  | 100件未満      | 45.00% | 0.0    | 3,428          | 226.49%                                 |
| 8   | 100.00 (デフォルト)  | -                             | -       | -           | -      | -      | -              | -                                       |
| 9   | 小計              | 1,162,907                     | 0.13%   | 0.1         | 44.26% | 0.5    | 90,888         | 7.81%                                   |
| 金融機関等向けエクスポージャー                                     |                 |                               |         |             |        |        |                |   |
| 1   | 0.00以上0.15未満    | 2,281,784                     | 0.05%   | 0.3         | 35.94% | 0.9    | 289,657        | 12.69%                                  |
| 2   | 0.15以上0.25未満    | 152,441                       | 0.19%   | 100件未満      | 40.87% | 1.0    | 47,765         | 31.33%                                  |
| 3   | 0.25以上0.50未満    | 153,685                       | 0.35%   | 0.1         | 17.31% | 1.8    | 27,159         | 17.67%                                  |
| 4   | 0.50以上0.75未満    | 188,990                       | 0.61%   | 100件未満      | 13.33% | 1.4    | 45,915         | 24.29%                                  |
| 5   | 0.75以上2.50未満    | 102,506                       | 1.67%   | 100件未満      | 10.73% | 1.1    | 19,197         | 18.72%                                  |
| 6   | 2.50以上10.00未満   | 168,297                       | 4.79%   | 100件未満      | 9.65%  | 2.0    | 50,795         | 30.18%                                  |
| 7   | 10.00以上100.00未満 | 3,799                         | 27.71%  | 100件未満      | 45.00% | 0.9    | 8,916          | 234.68%                                 |
| 8   | 100.00 (デフォルト)  | 370                           | 100.00% | 100件未満      | 45.00% | 1.0    | 0              | 0.00%                                   |
| 9   | 小計              | 3,051,876                     | 0.47%   | 0.8         | 31.56% | 1.0    | 489,407        | 16.03%                                  |
| 事業法人向けエクスポージャー                                      |                 |                               |         |             |        |        |                |   |
| 1   | 0.00以上0.15未満    | 2,103,443                     | 0.06%   | 5.3         | 40.66% | 1.2    | 304,944        | 14.49%                                  |
| 2   | 0.15以上0.25未満    | 213,704                       | 0.19%   | 0.5         | 44.99% | 1.0    | 75,460         | 35.31%                                  |
| 3   | 0.25以上0.50未満    | 310,309                       | 0.33%   | 0.4         | 42.41% | 1.0    | 147,087        | 47.40%                                  |
| 4   | 0.50以上0.75未満    | 99,530                        | 0.61%   | 0.2         | 34.90% | 1.0    | 59,373         | 59.65%                                  |
| 5   | 0.75以上2.50未満    | 232,284                       | 1.41%   | 0.3         | 35.78% | 1.2    | 181,467        | 78.12%                                  |
| 6   | 2.50以上10.00未満   | 206,146                       | 6.02%   | 0.3         | 34.91% | 0.9    | 238,824        | 115.85%                                 |
| 7   | 10.00以上100.00未満 | 148,795                       | 27.71%  | 1.8         | 27.98% | 0.8    | 241,086        | 162.02%                                 |
| 8   | 100.00 (デフォルト)  | 13,671                        | 100.00% | 100件未満      | 45.00% | 1.0    | 0              | 0.00%                                   |
| 9   | 小計              | 3,327,885                     | 2.22%   | 9.2         | 39.68% | 1.1    | 1,248,245      | 37.50%                                  |
| 合計 (全てのポートフォリオ)                                     |                 | 7,542,669                     | 1.19%   | 10.2        | 37.10% | 1.0    | 1,828,541      | 24.24%                                  |

2019年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

| CCR4：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  | PD区分            | イ                             | ロ       | ハ           | ニ      | ホ      | ヘ              | ト                                       |
|   |                 | EAD<br>(信用リスク<br>削減効果勘案<br>後) | 平均PD    | 取引相手方の<br>数 | 平均LGD  | 平均残存期間 | 信用リスク・<br>アセット | リスク・ウェ<br>イトの加重平<br>均值 (RWA<br>density) |
| ソブリン向けエクスポージャー                                      |                 |                               |         |             |        |        |                |   |
| 1   | 0.00以上0.15未満    | 1,122,678                     | 0.01%   | 0.1         | 43.62% | 0.3    | 32,416         | 2.88%                                   |
| 2   | 0.15以上0.25未満    | 7,281                         | 0.20%   | 100件未満      | 45.00% | 0.7    | 2,047          | 28.12%                                  |
| 3   | 0.25以上0.50未満    | 33,883                        | 0.31%   | 100件未満      | 45.00% | 0.8    | 13,044         | 38.49%                                  |
| 4   | 0.50以上0.75未満    | 7,123                         | 0.63%   | 100件未満      | 45.00% | 0.0    | 3,356          | 47.11%                                  |
| 5   | 0.75以上2.50未満    | -                             | -       | -           | -      | -      | -              | -                                       |
| 6   | 2.50以上10.00未満   | 45,823                        | 5.25%   | 100件未満      | 45.00% | 1.5    | 64,125         | 139.93%                                 |
| 7   | 10.00以上100.00未満 | 1,229                         | 27.47%  | 100件未満      | 45.00% | 0.0    | 2,782          | 226.31%                                 |
| 8   | 100.00 (デフォルト)  | -                             | -       | -           | -      | -      | -              | -                                       |
| 9   | 小計              | 1,218,020                     | 0.25%   | 0.1         | 43.73% | 0.4    | 117,772        | 9.66%                                   |
| 金融機関等向けエクスポージャー                                     |                 |                               |         |             |        |        |                |   |
| 1   | 0.00以上0.15未満    | 2,215,046                     | 0.06%   | 0.3         | 39.12% | 0.8    | 311,250        | 14.05%                                  |
| 2   | 0.15以上0.25未満    | 167,046                       | 0.20%   | 100件未満      | 32.88% | 0.8    | 45,099         | 26.99%                                  |
| 3   | 0.25以上0.50未満    | 498,975                       | 0.34%   | 0.1         | 10.80% | 1.2    | 67,315         | 13.49%                                  |
| 4   | 0.50以上0.75未満    | 92,089                        | 0.63%   | 100件未満      | 8.09%  | 1.7    | 10,004         | 10.86%                                  |
| 5   | 0.75以上2.50未満    | 184,873                       | 1.58%   | 100件未満      | 5.94%  | 2.3    | 22,037         | 11.92%                                  |
| 6   | 2.50以上10.00未満   | 41,582                        | 6.07%   | 100件未満      | 12.11% | 1.3    | 15,592         | 37.49%                                  |
| 7   | 10.00以上100.00未満 | 24,677                        | 27.47%  | 100件未満      | 17.32% | 0.8    | 22,591         | 91.54%                                  |
| 8   | 100.00 (デフォルト)  | 729                           | 100.00% | 100件未満      | 45.00% | 1.0    | 0              | 0.00%                                   |
| 9   | 小計              | 3,225,021                     | 0.52%   | 0.8         | 31.11% | 1.0    | 493,892        | 15.31%                                  |
| 事業法人向けエクスポージャー                                      |                 |                               |         |             |        |        |                |   |
| 1   | 0.00以上0.15未満    | 2,112,719                     | 0.06%   | 5.7         | 40.22% | 1.2    | 319,385        | 15.11%                                  |
| 2   | 0.15以上0.25未満    | 217,730                       | 0.20%   | 0.5         | 44.96% | 1.2    | 86,669         | 39.80%                                  |
| 3   | 0.25以上0.50未満    | 256,568                       | 0.35%   | 0.5         | 42.19% | 1.0    | 127,585        | 49.72%                                  |
| 4   | 0.50以上0.75未満    | 165,157                       | 0.63%   | 0.2         | 27.74% | 1.0    | 87,381         | 52.90%                                  |
| 5   | 0.75以上2.50未満    | 312,095                       | 1.30%   | 0.3         | 36.61% | 0.9    | 236,449        | 75.76%                                  |
| 6   | 2.50以上10.00未満   | 168,051                       | 7.10%   | 0.3         | 35.84% | 0.8    | 209,939        | 124.92%                                 |
| 7   | 10.00以上100.00未満 | 92,852                        | 27.47%  | 1.4         | 38.98% | 0.8    | 208,416        | 224.46%                                 |
| 8   | 100.00 (デフォルト)  | 1                             | 100.00% | 100件未満      | 45.00% | 1.0    | 0              | 0.00%                                   |
| 9   | 小計              | 3,325,177                     | 1.36%   | 9.1         | 39.47% | 1.1    | 1,275,828      | 38.36%                                  |
| 合計 (全てのポートフォリオ)                                     |                 | 7,768,219                     | 0.84%   | 10.2        | 36.67% | 1.0    | 1,887,493      | 24.29%                                  |

(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。

## CCR5：担保の内訳

2020年9月末

(単位：百万円)

| CCR5：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） | -              | 1,131,955  | -         | 1,793,579  | 1,557,355       | 4,521,079  |
| 2          | 現金（外国通貨） | -              | 2,393,081  | -         | 1,223,463  | 31,297,078      | 27,794,203 |
| 3          | 国内ソブリン債  | 88,890         | 162,336    | 505,419   | 113,305    | 4,051,151       | 1,756,210  |
| 4          | その他ソブリン債 | 247,337        | 232,464    | 7,546     | 174,196    | 22,048,386      | 19,360,332 |
| 5          | 政府関係機関債  | -              | 15,560     | -         | -          | 748,795         | 1,467,610  |
| 6          | 社債       | 23,464         | 116,001    | -         | 20,756     | 7,967,401       | 20,312,755 |
| 7          | 株式       | 4,989          | 313,609    | 2,707     | 424,539    | 3,752,267       | 3,966,208  |
| 8          | その他担保    | 2,016          | 7,062      | -         | 24         | 44,610          | 35,024     |
| 9          | 合計       | 366,699        | 4,372,072  | 515,672   | 3,749,865  | 71,467,047      | 79,213,423 |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CCR5：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） | -              | 1,015,774  | -         | 1,821,730  | 1,429,635       | 5,451,914  |
| 2          | 現金（外国通貨） | -              | 2,413,861  | -         | 1,143,854  | 36,181,925      | 31,367,906 |
| 3          | 国内ソブリン債  | 100,040        | 161,162    | 496,962   | 92,987     | 4,431,045       | 1,716,579  |
| 4          | その他ソブリン債 | 287,174        | 257,126    | 9,223     | 111,609    | 28,595,134      | 28,009,989 |
| 5          | 政府関係機関債  | 2              | 7,043      | -         | 5,777      | 1,429,139       | 1,436,626  |
| 6          | 社債       | 25,050         | 160,367    | 2,000     | 41,515     | 4,646,904       | 15,330,890 |
| 7          | 株式       | 31,632         | 615,050    | 4         | 599,400    | 3,845,276       | 4,154,762  |
| 8          | その他担保    | 5,093          | 6,124      | -         | -          | 3,694           | 108,295    |
| 9          | 合計       | 448,994        | 4,636,510  | 508,190   | 3,816,874  | 80,562,755      | 87,576,963 |

CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

2020年9月末

(単位：百万円)

| CCR6：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 | 7,157,462   | 7,366,192   |
| 2                            | インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ  | 8,508,078   | 9,076,180   |
| 3                            | トータル・リターン・スワップ           | 1,318,601   | 383,946     |
| 4                            | クレジットオプション               | 6,197       | 6,197       |
| 5                            | その他のクレジット・デリバティブ         | -           | -           |
| 6                            | 想定元本合計                   | 16,990,339  | 16,832,515  |
|                              | 公正価値                     |             |             |
| 7                            | プラスの公正価値（資産）             | 66,067      | 170,352     |
| 8                            | マイナスの公正価値（負債）            | △177,256    | △56,558     |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CCR6：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 | 7,763,343   | 8,418,016   |
| 2                            | インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ  | 6,575,102   | 6,721,965   |
| 3                            | トータル・リターン・スワップ           | 969,791     | 258,482     |
| 4                            | クレジットオプション               | 81,270      | 11,748      |
| 5                            | その他のクレジット・デリバティブ         | -           | -           |
| 6                            | 想定元本合計                   | 15,389,508  | 15,410,213  |
|                              | 公正価値                     |             |             |
| 7                            | プラスの公正価値（資産）             | 47,945      | 253,677     |
| 8                            | マイナスの公正価値（負債）            | △240,693    | △37,614     |

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)

| 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 |                                   |                             |         |
|--|-----------------------------------|-----------------------------|---------|
| 項番   |                                   | 信用リスク・アセットの額                |         |
| 1  | 前四半期末時点（2020年6月末）における信用リスク・アセットの額 | 1,183,492                   |         |
| 2  | 当四半期中の要因別の変動額                     | 資産の規模                       | 48,514  |
| 3  |                                   | 取引相手方の信用力                   | △51,402 |
| 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                       | △18,998 |
| 8  |                                   | その他                         | —       |
| 9  | 当四半期末時点（2020年9月末）における信用リスク・アセットの額 | 1,161,606                   |         |

## CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

2020年9月末

(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）                   |                                | 184,512    |
| 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。）     | 5,965,228                      | 119,304    |
| 3                     | （i）派生商品取引（上場以外）                          | 5,137,155                      | 102,743    |
| 4                     | （ii）派生商品取引（上場）                           | 485,979                        | 9,719      |
| 5                     | （iii）レポ形式の取引                             | 342,093                        | 6,841      |
| 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                          | 501,270                        | 10,025     |
| 9                     | 事前拠出された清算基金                              | 192,443                        | 55,182     |
| 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）                  |                                | 154,990    |
| 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。）    | 103,440                        | 85,690     |
| 13                    | （i）派生商品取引（上場以外）                          | 46,612                         | 46,612     |
| 14                    | （ii）派生商品取引（上場）                           | 34,473                         | 34,473     |
| 15                    | （iii）レポ形式の取引                             | 22,355                         | 4,604      |
| 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                          | 50,066                         | 50,046     |
| 19                    | 事前拠出された清算基金                              | 1,540                          | 19,253     |
| 20                    | 未拠出の清算基金                                 | -                              | -          |

2019年9月末

(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）                   |                                | 182,696    |
| 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。）     | 5,418,051                      | 108,361    |
| 3                     | （i）派生商品取引（上場以外）                          | 4,275,395                      | 85,507     |
| 4                     | （ii）派生商品取引（上場）                           | 696,596                        | 13,931     |
| 5                     | （iii）レポ形式の取引                             | 446,059                        | 8,921      |
| 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                          | 347,611                        | 6,952      |
| 9                     | 事前拠出された清算基金                              | 150,288                        | 67,383     |
| 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）                  |                                | 112,515    |
| 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。）    | 79,461                         | 62,049     |
| 13                    | （i）派生商品取引（上場以外）                          | 43,197                         | 43,197     |
| 14                    | （ii）派生商品取引（上場）                           | 14,574                         | 14,449     |
| 15                    | （iii）レポ形式の取引                             | 21,689                         | 4,402      |
| 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                          | 31,295                         | 31,294     |
| 19                    | 事前拠出された清算基金                              | 1,533                          | 19,171     |
| 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。）

2020年9月末

（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）           | —             | —        | —  | 13,410      | —        | 13,410 | 42,467     | —        | 42,467 |
| 2   | 担保付住宅ローン           | —             | —        | —  | 13,410      | —        | 13,410 | 37,229     | —        | 37,229 |
| 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 | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 5,184      | —        | 5,184  |
| 5   | 再証券化               | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 53         | —        | 53     |
| 6   | ホールセール（合計）         | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 21,361     | 37       | 21,398 |
| 7   | 事業法人向けローン          | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 18,321     | —        | 18,321 |
| 8   | 商業用モーゲージ担保証券       | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 1,267      | 37       | 1,304  |
| 9   | リース債権及び売掛債権        | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 1,167      | —        | 1,167  |
| 10  | その他のホールセール         | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 605        | —        | 605    |
| 11  | 再証券化               | —             | —        | —  | —           | —        | —      | —          | —        | —      |

2019年9月末

（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）           | —             | —        | —  | 17,756      | —        | 17,756 | 54,310     | —        | 54,310 |
| 2   | 担保付住宅ローン           | —             | —        | —  | 17,756      | —        | 17,756 | 45,387     | —        | 45,387 |
| 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 | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 6,903      | —        | 6,903  |
| 5   | 再証券化               | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 2,020      | —        | 2,020  |
| 6   | ホールセール（合計）         | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 64,902     | 168      | 65,070 |
| 7   | 事業法人向けローン          | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 53,420     | —        | 53,420 |
| 8   | 商業用モーゲージ担保証券       | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 1,288      | 168      | 1,456  |
| 9   | リース債権及び売掛債権        | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 2,193      | —        | 2,193  |
| 10  | その他のホールセール         | —             | —        | —  | —           | —        | —      | 7,999      | —        | 7,999  |
| 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<br>(リスク相当額を8パーセントで除して得た額) |           |
|                           |                         | 2020年9月末                           | 2019年9月末  |
| 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   | 700,344                            | 1,091,716 |
| 9                         | 合計                      | 700,344                            | 1,091,716 |

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・リスク | ストレステスト・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（2020年6月末）におけるリスク・アセット          | 1,830,712    | 1,284,629   | 1,768,997 | 109,161  |        | 4,993,500 |            |
| 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     | 1.38         | 1.67        | 1.08      | 1.00     |        | 1.26      |            |
| 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           | 1,322,777    | 765,331     | 1,634,223 | 109,161  |        | 3,831,492 |            |
| 2                                     | 当四半期中の要因別の変動額                        | リスク量の変動      | 1,344,791   | 361,725   | △338,073 | 14,933 |           | 1,383,377  |
| 3                                     |                                      | モデルの更新又は変更   | △904,918    | △132,258  | －        | －      |           | △1,037,176 |
| 4                                     |                                      | 手法及び方針       | －           | －         | －        | －      |           | －          |
| 5                                     |                                      | 買収及び売却       | －           | －         | －        | －      |           | －          |
| 6                                     |                                      | 為替の変動        | △34,532     | △19,489   | △25,393  | △2,431 |           | △81,847    |
| 7                                     | その他                                  | －            | －           | －         | －        |        | －         |            |
| 8a                                    | 当四半期末（2020年9月末）の算出基準日における内部モデル方式の算出額 | 1,728,117    | 975,309     | 1,270,755 | 121,664  |        | 4,095,846 |            |
| 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     | 0.82         | 0.85        | 1.06      | 1.00     |        | 0.92      |            |
| 8c                                    | 当四半期末におけるリスク・アセット                    | 1,433,585    | 838,023     | 1,359,105 | 121,664  |        | 3,752,378 |            |

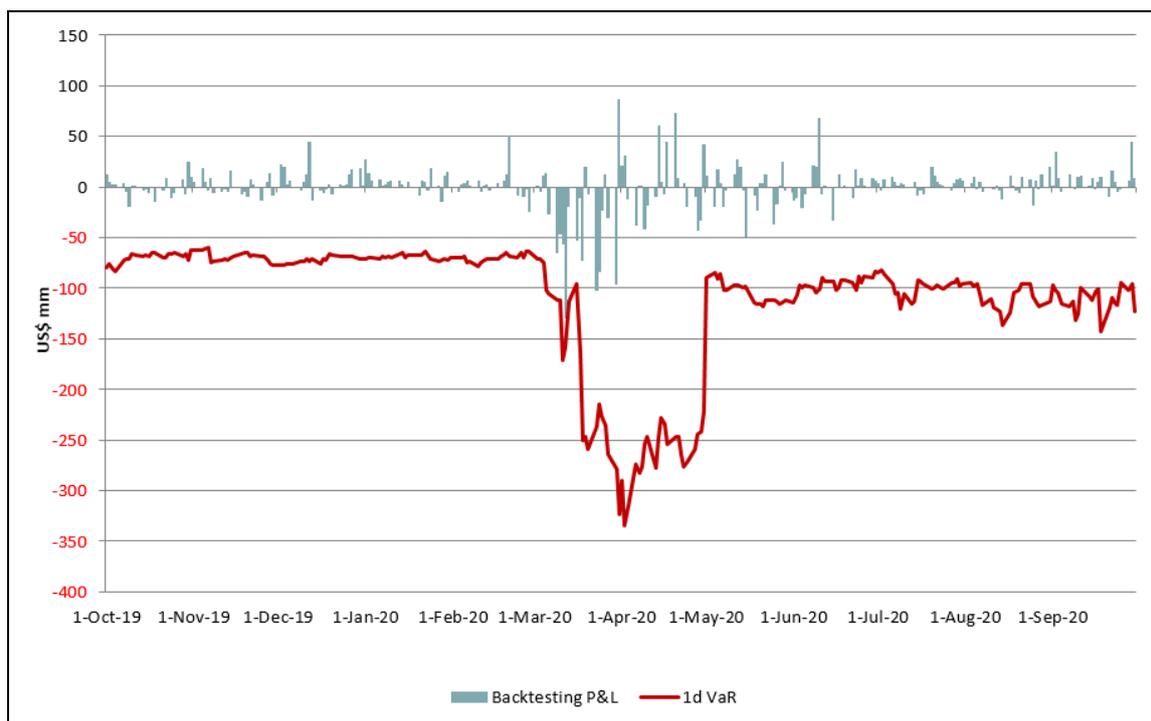
## MR 3 : 内部モデル方式の状況 (マーケット・リスク)

(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                                      |               | 2020年9月末 | 2019年9月末 |
| バリュー・アット・リスク (保有期間10営業日、片側信頼区間99%)      |               |          |          |
| 1                                       | 最大値           | 120,049  | 24,817   |
| 2                                       | 平均値           | 45,817   | 21,454   |
| 3                                       | 最小値           | 15,717   | 14,009   |
| 4                                       | 期末            | 46,083   | 22,345   |
| ストレス・バリュー・アット・リスク (保有期間10営業日、片側信頼区間99%) |               |          |          |
| 5                                       | 最大値           | 66,824   | 55,682   |
| 6                                       | 平均値           | 29,395   | 36,359   |
| 7                                       | 最小値           | 17,911   | 22,740   |
| 8                                       | 期末            | 26,008   | 44,736   |
| 追加的リスクの額 (片側信頼区間99.9%)                  |               |          |          |
| 9                                       | 最大値           | 233,100  | 125,401  |
| 10                                      | 平均値           | 136,107  | 107,355  |
| 11                                      | 最小値           | 108,728  | 102,815  |
| 12                                      | 期末            | 108,728  | 112,005  |
| 包括的リスクの額 (片側信頼区間99.9%)                  |               |          |          |
| 13                                      | 最大値           | 10,068   | 5,960    |
| 14                                      | 平均値           | 8,720    | 5,162    |
| 15                                      | 最小値           | 7,182    | 4,328    |
| 16                                      | 期末            | 9,733    | 5,272    |
| 17                                      | フロア (修正標準的方式) | 9,733    | 5,272    |

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・テスト超過は発生しておりません。



(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（ $\Delta$ 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 $\Delta$ EVEは、2020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（ $\Delta$ NII）

野村の資産負債構成における $\Delta$ 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 $\Delta$ 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。

## (8) マクロプラードシス監督措置に関する事項

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況

(単位：百万円, %)

| CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況 |             |  |                     |                     |
|---------------------------------------|-------------|--|---------------------|---------------------|
|                                       | イ           | ロ  | ハ                   | ニ                   |
| 国又は地域                                 | 各金融当局が定める比率 | カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額 | カウンター・シクリカル・バッファー比率 | カウンター・シクリカル・バッファーの額 |
| 香港                                    | 1.00%       | 60,395   |                     |                     |
| ルクセンブルク                               | 0.25%       | 176,574  |                     |                     |
| 小計                                    |             | 236,970  |                     |                     |
| 合計                                    |             | 5,661,071  | 0.01%               | 1,683,412           |

(注)

ロ欄の国又は地域ごとの信用リスク・アセットの額は、原則、最終リスクベースの国又は地域にもとづき算出しております。土地・建物等のその他資産並びに一部の事業法人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、株式等エクスポージャーおよびリスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーについては、記帳地を用いて算出しております。

#### 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）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |                         |
|---------------------------|--|-------------------------|
| 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                     |
| 3a                        | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |                         |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |                         |
| 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(3)             |                         |
| 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(4)                    |                         |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 594,493百万円              |
| 9                         | 額面総額(5)                                    |                         |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 株主資本                    |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 株主資本                    |
| 11                        | 発行日(7)                                     |                         |
| 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(8)                         |                         |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                |                         |
| 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(10)           |                         |
|                           | 剰余金の配当又は利息の支払                              |                         |
| 17                        | 配当率又は利率の種別(11)                             |                         |
| 18                        | 配当率又は利率(12)                                |                         |
| 19                        | 配当等停止条項の有無(13)                             |                         |
| 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(14)           |                         |
| 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(15)          |   |
| 25 | 転換の範囲(16)             |   |
| 26 | 転換の比率(17)             |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)    |   |
| 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(19)     | 無 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)       |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲(21)       |   |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)         |   |
| 34 | その概要                  |   |

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）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |   |
|---------------------------|--|---|
| 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   |
| 3 a                       | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |   |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |   |
| 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(3)             |   |
| 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<br>(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(4)                    |   |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 165,000百万円  |
| 9                         | 額面総額(5)                                    | 165,000百万円  |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 負債  |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 負債  |
| 11                        | 発行日(7)                                     | 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(8)                         | 初回償還可能日：2021年6月15日<br>償還金額：各社債の金額100円につき100円  |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                | 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(10)           | 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(11)                             | 固定から変動  |

|    |  |  |
|----|--|--|
| 18 | 配当率又は利率(12)                            | 2016年1月28日から2021年6月15日まで：<br>年3.36パーセント<br>2021年6月15日の翌日以降：<br>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(13)                         | 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(14)       | 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(15)                           |  |
| 25 | 転換の範囲(16)                              |  |
| 26 | 転換の比率(17)                              |  |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)                     |  |
| 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(19)                      | 有  |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)                        | (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<br>(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<br>(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(21)                        | 全部削減または一部削減  |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)                          | 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   |

## ■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）  
自己資本調達手段（劣後債）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |   |
|---------------------------|--|---|
| 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                      | JP376260AL69  |
| 3                         | 準拠法  | 日本法   |
| 3a                        | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |   |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |   |
| 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(3)             |   |
| 7                         | 銘柄、名称又は種類                                  | 第2回任意償還条項付無担保永久社債<br>(債務免除特約及び劣後特約付)  |
| 8                         | 自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)                    |   |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 150,000百万円  |
| 9                         | 額面総額(5)                                    | 150,000百万円  |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 負債  |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 負債  |
| 11                        | 発行日(7)                                     | 2020年6月18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(8)                         | 初回償還可能日：2025年7月18日<br>償還金額：各社債の金額100円につき100円  |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                | 2025年7月18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(10)           | 2025年7月18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(11)                             | 固定から変動  |

|    |  |  |
|----|--|--|
| 18 | 配当率又は利率(12)                            | 2020年6月19日から2025年7月18日まで：<br>年1.80パーセント<br>2025年7月18日の翌日以降：<br>6か月物ユーロ円LIBOR + 1.84パーセント   |
| 19 | 配当等停止条項の有無(13)                         | 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(14)       | 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(15)                           |  |
| 25 | 転換の範囲(16)                              |  |
| 26 | 転換の比率(17)                              |  |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)                     |  |
| 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(19)                      | 有  |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)                        | (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<br>(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<br>(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(21)                        | 全部削減または一部削減  |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)                          | 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   |

## ■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。

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

自己資本調達手段（劣後債）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |                               |
|---------------------------|--|-------------------------------|
| 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                           |
| 3a                        | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |                               |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |                               |
| 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(3)             |                               |
| 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(4)                    |                               |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 7,900百万円                      |
| 9                         | 額面総額(5)                                    | 39,500百万円                     |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 負債                            |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 負債                            |
| 11                        | 発行日(7)                                     | 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(8)                         |                               |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                |                               |
| 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(10)           |                               |
|                           | 剰余金の配当又は利息の支払                              |                               |
| 17                        | 配当率又は利率の種別(11)                             | 固定                            |
| 18                        | 配当率又は利率(12)                                | 年2.649パーセント                   |
| 19                        | 配当等停止条項の有無(13)                             | 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(14)           | 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(15)            |   |
| 25 | 転換の範囲(16)               |   |
| 26 | 転換の比率(17)               |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)      |   |
| 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(19)       | 無 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)         |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲(21)         |   |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)           |   |
| 34 | その概要                    |   |

## ■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）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |   |
|---------------------------|--|---|
| 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   |
| 3a                        | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |   |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |   |
| 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(3)             |   |
| 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(4)                    |   |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 11,340百万円   |
| 9                         | 額面総額(5)                                    | 57,700百万円   |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 負債  |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 負債  |
| 11                        | 発行日(7)                                     | 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(8)                         | 初回償還可能日：2020年11月26日<br>償還金額：各社債の金額100円につき100円                               |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                | 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(10)           | 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(11)                             | 固定  |
| 18                        | 配当率又は利率(12)                                | 年2.749パーセント   |
| 19                        | 配当等停止条項の有無(13)                             | 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(14)           |   |
| 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(15)            |   |
| 25 | 転換の範囲(16)               |   |
| 26 | 転換の比率(17)               |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)      |   |
| 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(19)       | 無 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)         |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲(21)         |   |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)           |   |
| 34 | その概要                    |   |

## ■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）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |   |
|---------------------------|--|---|
| 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   |
| 3a                        | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |   |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |   |
| 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(3)             |   |
| 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(4)                    |   |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 1,200百万円  |
| 9                         | 額面総額(5)                                    | 6,000百万円  |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 負債  |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 負債  |
| 11                        | 発行日(7)                                     | 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(8)                         | 初回償還可能日：2020年11月26日<br>償還金額：各社債の金額100円につき100円                               |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                | 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(10)           | 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(11)                             | 変動  |
| 18                        | 配当率又は利率(12)                                | 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(13)                             | 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(14)           | 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(15)            |   |
| 25 | 転換の範囲(16)               |   |
| 26 | 転換の比率(17)               |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)      |   |
| 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(19)       | 無 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)         |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲(21)         |   |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)           |   |
| 34 | その概要                    |   |

## ■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. 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）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |   |
|---------------------------|--|---|
| 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   |
| 3a                        | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |   |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |   |
| 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(3)             |   |
| 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(4)                    |   |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 10,000百万円   |
| 9                         | 額面総額(5)                                    | 50,000百万円   |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 負債  |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 負債  |
| 11                        | 発行日(7)                                     | 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(8)                         | 初回償還可能日：2020年11月26日<br>償還金額：各社債の金額100円につき100円                               |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                | 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(10)           | 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(11)                             | 固定  |
| 18                        | 配当率又は利率(12)                                | 年2.773パーセント   |
| 19                        | 配当等停止条項の有無(13)                             | 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(14)           | 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(15)            |   |
| 25 | 転換の範囲(16)               |   |
| 26 | 転換の比率(17)               |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)      |   |
| 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(19)       | 無 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)         |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲(21)         |   |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)           |   |
| 34 | その概要                    |   |

## ■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。

## 8. 非支配株主持分

### 自己資本調達手段（非支配株主持分）

| CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要 |  |   |
|---------------------------|--|---|
| 1                         | 発行者  | 野村東方国際証券有限公司、株式会社杉村倉庫 他                     |
| 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  | 中華人民共和国法、日本法 他                              |
| 3 a                       | 外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)         |   |
|                           | 規制上の取扱い(2)                                 |   |
| 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Tier 1 資本に係る基礎項目の額<br>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<br>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(3)             |   |
| 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(4)                    |   |
|                           | 連結自己資本規制比率                                 | 3,234百万円                                    |
| 9                         | 額面総額(5)                                    |   |
| 10                        | 表示される科目の区分(6)                              | 非支配株主持分                                     |
|                           | 連結貸借対照表                                    | 非支配株主持分                                     |
| 11                        | 発行日(7)                                     |   |
| 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(8)                         |   |
|                           | 特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)                |   |
| 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(10)           |   |
|                           | 剰余金の配当又は利息の支払                              |   |
| 17                        | 配当率又は利率の種別(11)                             |   |
| 18                        | 配当率又は利率(12)                                |   |
| 19                        | 配当等停止条項の有無(13)                             |   |
| 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(14)           |   |
| 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(15)          |   |
| 25 | 転換の範囲(16)             |   |
| 26 | 転換の比率(17)             |   |
| 27 | 転換に係る発行者の裁量の有無(18)    |   |
| 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(19)     | 無 |
| 31 | 元本の削減が生じる場合(20)       |   |
| 32 | 元本の削減が生じる範囲(21)       |   |
| 33 | 元本回復特約の有無(22)         |   |
| 34 | その概要                  |   |

## 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<br>(表2)の<br>該当番号 | 国際様式<br>(表1)の<br>該当番号 | 項目  | 2020年9月末   | 2020年6月末   | 2019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                                   | 22,936,246 | 23,324,973 | 26,004,367 |
| 1 a                   | 1                     | 連結貸借対照表における総資産の額                                      | 40,032,489 | 39,540,383 | 45,677,106 |
| 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)                    | 123,476    | 135,877    | 122,461    |
| 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(△)                 | 16,972,766 | 16,079,532 | 19,550,277 |
| 2                     | 7                     | Tier1資本に係る調整項目の額(△)                                   | 169,979    | 163,353    | 156,926    |
| 3                     |                       | オン・バランス資産の額(イ)  | 22,766,266 | 23,161,619 | 25,847,440 |
| 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RCの額に1.4を乗じた額                            | 1,578,602  | 1,680,531  | 1,544,114  |
| 5                     |                       | デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額                           | 4,180,166  | 3,920,644  | 4,524,927  |
| 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差し入れた担保の対価の額            | 1,591,879  | 1,621,423  | 1,487,511  |
| 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(△)           | 1,592,861  | 1,490,473  | 2,160,207  |
| 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              | 17,050,725 | 16,705,801 | 15,506,872 |
| 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(△)    | 15,666,699 | 15,465,474 | 14,035,968 |
| 11                    | 4                     | デリバティブ取引等に関する額(ロ)                                     | 7,141,813  | 6,972,452  | 6,867,248  |

(単位：百万円、%)

| 国際様式<br>(表2)の<br>該当番号           | 国際様式<br>(表1)の<br>該当番号 | 項目                                     | 2020年9月末   | 2020年6月末   | 2019年9月末   |
|---------------------------------|-----------------------|--|------------|------------|------------|
| 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                          | 31,624,973 | 31,603,267 | 35,859,887 |
| 13                              |                       | レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)                | 16,059,025 | 17,177,425 | 17,622,228 |
| 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      | 1,155,218  | 1,243,899  | 1,628,151  |
| 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)                          | 16,721,166 | 15,669,742 | 19,865,811 |
| 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                       | 3,122,898  | 3,391,218  | 3,571,586  |
| 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(△)      | 1,021,062  | 1,141,607  | 1,245,580  |
| 19                              | 6                     | オフ・バランス取引に関する額(ニ)                      | 2,101,835  | 2,249,611  | 2,326,005  |
| 連結レバレッジ比率(5)                    |                       |  |            |            |            |
| 20                              |                       | 資本の額(ホ)                                | 2,855,329  | 2,864,351  | 2,691,284  |
| 21                              | 8                     | 総エクスポージャーの額(イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)   | 48,731,083 | 48,053,426 | 54,906,506 |
| 22                              |                       | 連結レバレッジ比率(ホ) / (ヘ)                     | 5.85%      | 5.96%      | 4.90%      |
| 日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6) |                       |  |            |            |            |
|                                 |                       | 総エクスポージャーの額(ヘ)                         | 48,731,083 | 48,053,426 |            |
|                                 |                       | 日本銀行に対する預け金の額                          | 2,651,947  | 2,005,010  |            |
|                                 |                       | 日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額(ヘ')     | 51,383,030 | 50,058,436 |            |
|                                 |                       | 日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(ホ) / (ヘ') | 5.55%      | 5.72%      |            |

(注)

- 「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の補完的指標として定めるレバレッジに係る健全性を判断するための基準」(平成31年金融庁告示13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。
- 2019年9月末から2020年9月末にかけての連結レバレッジ比率の上昇は、2020年6月30日付告示改正に伴い日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたこと、またレポ取引等に関する額の減少によるものです。

## 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<br>(2021年3月期 第2 四半期) |                  | 前最終指定親会社四半期<br>(2021年3月期 第1 四半期) |                  |
|-------------------------|---|----------------------------------|------------------|----------------------------------|------------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>       |   |                                  |                  |                                  |                  |
| 1                       | 適格流動資産の合計額  | 5,888,043                        |                  | 4,936,941                        |                  |
| <b>資金流出額 (2)</b>        |   | 資金流出率を<br>乗じる前の額                 | 資金流出率を<br>乗じた後の額 | 資金流出率を<br>乗じる前の額                 | 資金流出率を<br>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                                     | 508,210                          | 61,984           | 473,523                          | 62,069           |
| 3                       | うち、安定預金の額   | —                                | —                | —                                | —                |
| 4                       | うち、準安定預金の額  | 508,210                          | 61,984           | 473,523                          | 62,069           |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                                   | 1,627,406                        | 1,443,713        | 1,719,520                        | 1,532,840        |
| 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<br>有価証券以外のホールセール無担保資金調達<br>に係る資金の額 | 1,165,639                        | 981,946          | 1,197,502                        | 1,010,823        |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額  | 461,767                          | 461,767          | 522,018                          | 522,018          |
| 9                       | 有担保資金調達等に係る資金流出額  |                                  |                  | 2,514,051                        |                  |
| 10                      | デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与<br>信・流動性ファシリティに係る資金流出額           | 2,130,152                        | 1,784,425        | 2,166,947                        | 1,899,725        |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                    | 1,662,819                        | 1,662,819        | 1,780,831                        | 1,780,831        |
| 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<br>流出額                             | 467,333                          | 121,606          | 386,116                          | 118,894          |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等  | 3,473,426                        | 914,888          | 3,901,970                        | 999,431          |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額  | 406,970                          | 186,239          | 392,970                          | 179,465          |
| 16                      | 資金流出合計額   | 7,092,999                        |                  | 7,187,581                        |                  |
| <b>資金流入額 (3)</b>        |   | 資金流入率を<br>乗じる前の額                 | 資金流入率を<br>乗じた後の額 | 資金流入率を<br>乗じる前の額                 | 資金流入率を<br>乗じた後の額 |
| 17                      | 有担保資金運用等に係る資金流入額  | 27,544,297                       | 2,015,713        | 28,349,472                       | 1,966,064        |
| 18                      | 貸付金等の回収に係る資金流入額   | 1,059,813                        | 979,739          | 1,134,204                        | 1,058,168        |
| 19                      | その他資金流入額  | 4,045,601                        | 1,713,062        | 4,441,321                        | 1,844,463        |
| 20                      | 資金流入合計額   | 32,649,710                       | 4,708,513        | 33,924,997                       | 4,868,695        |
| <b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b> |   |                                  |                  |                                  |                  |
| 21                      | 算入可能適格流動資産の合計額  | 5,888,043                        |                  | 4,936,941                        |                  |
| 22                      | 純資金流出額  | 2,384,486                        |                  | 2,348,784                        |                  |
| 23                      | 連結流動性カバレッジ比率  | 248.4%                           |                  | 216.0%                           |                  |
| 24                      | 平均値計算用データ数  | 61                               |                  | 61                               |                  |

## 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9,511億2百万円増の5兆8,880億43百万円となりました。有担保資金調達等に係る資金流出額が同1,877億円増の2兆7017億51百万円、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が同1,153億円減の1兆7,844億25百万円、その他資金流入額が同1,314億1百万円減の1兆7,130億62百万円、純資金流出額は同357億2百万円増の2兆3,844億86百万円となりました。

この結果、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248.4%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、顧客との有価証券売買および貸借取引に伴うトレーディング在庫の変動、顧客との有担保資金調達・運用等及びデリバティブ取引等による資金流入金額の変化等が挙げられます。

### 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。

