

2020年12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12月31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 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	9
第3章 定量的な開示事項	11
第4章 自己資本調達手段に関する契約内容	15
1. 野村ホールディングス株式会社 普通株式	15
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）	17
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） ..	20
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）	23
5. 非支配株主持分	27
第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項	29
第2部 連結流動性規制に関する開示	31
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	32
第3部 開示方針	33

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 当番号	項目	イ		ロ
		2020年12月末	2020年9月末	別紙様式 第八号 (CC2)の参 照項目
普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目(1)				
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	2,923,096	2,816,950	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	1,284,700	1,277,726	1a
2	うち、利益剰余金の額	1,731,708	1,772,538	2
1c	うち、自己株式の額(△)	93,312	233,314	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	△132,679	△88,705	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)	2,790,416	2,728,244	
普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)				
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	104,103	106,592	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	12,207	12,445	
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	91,896	94,146	
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	3,971	4,501	
11	繰延ヘッジ損益の額	—	—	
12	適格引当金不足額	40,441	42,841	
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	△10,449	20,552	
15	退職給付に係る資産の額	14,778	14,293	
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	1,375	1,750	
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	イ		ロ	
		2020年12月末	2020年 9 月末	別紙様式 第八号 (CC2) 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）	154, 219	190, 532		
普通株式等Tier1 資本					
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)－(ロ)) (ハ)	2, 636, 197	2, 537, 712		
その他Tier1 資本に係る基礎項目(3)					
30	31a	その他Tier1 資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	—	—	
	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	1, 687	2, 617		
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)	316, 687	317, 617		

(単位：百万円、%)

国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2020年12月末	2020年 9 月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目
その他Tier1 資本に係る調整項目				
37	自己保有その他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
39	少数出資金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
40	その他金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
42	Tier2 資本不足額	—	—	
43	その他Tier1 資本に係る調整項目の額 (ホ)	—	—	
その他Tier1 資本				
44	その他Tier1 資本の額((ニ)－(ホ)) (ヘ)	316,687	317,617	
Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額((ハ)＋(ヘ)) (ト)	2,952,884	2,855,329	
Tier2 資本に係る基礎項目(4)				
46	Tier2 資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	—	—	
	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	396	615	
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	7,900	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	7,900	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)	8,296	31,055	

(単位：百万円、%)

国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2020年12月末	2020年 9 月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目
Tier2資本に係る調整項目(5)				
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)	—	—	
Tier2 資本				
58	Tier2 資本の額((チ)－(リ)) (ヌ)	8,296	31,055	
総自己資本				
59	総自己資本の合計((ト)＋(ヌ)) (ル)	2,961,181	2,886,385	
リスク・アセット(6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	14,974,069	15,037,167	
連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)／(ヲ))	17.60%	16.87%	
62	連結Tier1 比率((ト)／(ヲ))	19.71%	18.98%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))	19.77%	19.19%	
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	11.77%	11.19%	
調整項目に係る参考事項(8)				
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	149,677	149,595	
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	138,551	133,116	
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	11,329	4,838	

(単位：百万円、%)

国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2020年12月末	2020年 9 月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目
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)				
76	一般貸倒引当金の額	—	—	
77	一般貸倒引当金に係るTier2 資本算入上限額	—	—	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）	—	—	
79	適格引当金に係るTier2 資本算入上限額	—	—	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項(10)				
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	7,900	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。）	30,842	122,560	

第2章 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12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 連結貸借対照表	規制上の連結範囲 に基づく連結貸借 対照表	別紙様式第一号 (CC1) の参照項目
資産の部			
現金および現金同等物	3,367,527	3,328,925	
定期預金	269,681	269,681	
取引所預託金およびその他の顧客分別金	289,865	289,865	
貸付金	2,559,518	2,545,920	
顧客に対する受取債権	442,696	442,559	
顧客以外に対する受取債権	733,653	728,417	
貸倒引当金	△9,816	△9,816	
売戻条件付買入有価証券	12,522,320	12,522,320	
借入有価証券担保金	4,430,005	4,430,005	
トレーディング資産	17,553,772	16,521,455	
プライベート・エクイティ投資	56,517	36,405	
建物、土地、器具備品および設備	458,602	421,783	
トレーディング目的以外の負債証券	415,082	391,491	
投資持分証券	115,714	115,714	
関連会社に対する投資および貸付金	398,074	398,074	
その他	989,027	988,340	
資産の部合計	44,592,245	43,421,146	
負債の部			
短期借入	1,335,006	1,198,687	
顧客に対する支払債務	1,349,855	1,349,770	
顧客以外に対する支払債務	1,811,503	1,811,478	
受入銀行預金	1,200,047	1,200,047	
買戻条件付売却有価証券	15,361,463	15,463,212	
貸付有価証券担保金	1,472,905	1,478,922	
その他の担保付借入	394,182	394,182	
トレーディング負債	9,767,775	9,812,107	
その他の負債	1,181,100	1,141,041	
長期借入	7,865,014	7,099,445	
負債の部合計	41,738,852	40,948,894	
純資産の部			
資本金	594,492	594,492	1a
資本剰余金	690,208	690,208	1a
利益剰余金	1,734,914	1,730,996	2
累積的其他の包括利益	△132,679	△132,679	3
自己株式	△93,312	△93,312	1c
非支配持分	59,769	59,769	
純資産の部合計	2,853,392	2,849,473	
負債及び純資産の部合計	44,592,245	43,798,368	

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 連結貸借対照表	規制上の連結範囲 に基づく連結貸借 対照表	別紙様式第一号 (CC1) の参照項目
資産の部			
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	
負債の部			
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	
純資産の部			
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	
負債及び純資産の部合計	42,684,437	41,912,243	

(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) 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 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2020年12月末	2020年9月末	2020年6月末	2020年3月末	2019年12月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,636,197	2,537,712	2,546,444	2,404,634	2,534,259
2	Tier1資本の額	2,952,884	2,855,329	2,864,351	2,571,500	2,701,086
3	総自己資本の額	2,961,181	2,886,385	2,895,475	2,602,379	2,747,178
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	14,974,069	15,037,167	16,092,669	15,674,493	14,028,085
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	17.60%	16.87%	15.82%	15.34%	18.06%
6	連結Tier1比率	19.71%	18.98%	17.79%	16.40%	19.25%
7	連結総自己資本比率	19.77%	19.19%	17.99%	16.60%	19.58%
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 ファー比率	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%	0.11%
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%	3.01%	3.11%
12	連結資本バッファー比率	11.77%	11.19%	9.99%	8.60%	11.58%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	52,562,587	48,731,083	48,053,426	53,135,763	55,692,934
14	連結レバレッジ比率	5.61%	5.85%	5.96%	4.83%	4.84%

(単位：百万円、%)

（単位：百万円、％）

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2021年3月期 第3四半期	2021年3月期 第2四半期	2021年3月期 第1四半期	2020年3月期 第4四半期	2020年3月期 第3四半期
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	5,644,880	5,888,043	4,936,941	4,218,005	4,100,488
16	純資金流出額	2,519,111	2,384,486	2,348,784	2,109,636	2,153,762
17	連結流動性カバレッジ比率	231.5%	248.4%	216.0%	201.1%	192.3%

(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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	1,386,378	1,442,683	114,300	119,290
2	うち、標準的手法適用分	297,876	243,181	23,830	19,454
3	うち、内部格付手法適用分	706,245	807,566	59,889	68,481
	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	382,257	391,935	30,580	31,354
4	カウンターパーティ信用リスク	3,654,272	3,559,438	301,717	293,532
5	うち、SA-CCR適用分	581,794	535,649	49,230	45,358
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,182,214	1,161,606	100,251	98,504
	うち、CVAリスク	1,273,156	1,377,588	101,852	110,207
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	405,651	339,502	32,452	27,160
	その他	211,455	145,091	17,930	12,302
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	1,907,337	1,881,909	161,742	159,585
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）	80,750	84,100	6,847	7,131
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%）	224,147	222,643	19,004	18,877
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%）	105,000	154,347	8,400	12,347
11	未決済取引	11,291	6,049	930	494
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	4,336,974	4,452,722	346,957	356,217
17	うち、標準的方式適用分	670,779	700,344	53,662	56,027
18	うち、内部モデル方式適用分	3,666,194	3,752,378	293,295	300,190
19	オペレーショナル・リスク	2,578,119	2,578,119	206,249	206,249
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	2,578,119	206,249	206,249
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	374,703	344,887	31,774	29,246
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	14,974,069	15,037,167	1,197,925	1,202,973

(3) リスク・アセットの変動表

CR 8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

(単位：百万円)

CR 8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,395,617	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△69,516
3		ポートフォリオの質	20,506
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	△3,244
8		その他	－
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,343,363	

(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。

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番			信用リスク・アセットの額
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額		1,161,606
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	15,928
3		取引相手方の信用力	12,608
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）	10,870
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	△18,798
8		その他	－
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額		1,182,214

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	
		バリュース・アット・リスク	ストレス・バリュース・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計	
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	1,433,585	838,023	1,359,105	121,664		3,752,378	
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	0.82	0.85	1.06	1.00		0.92	
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	1,728,117	975,309	1,270,755	121,664		4,095,846	
2	当四半期中の 要因別の変動 額	リスク量の変動	△260,014	△146,597	363,554	△16,776		△59,833
3		モデルの更新又は変更	18,232	38,524	—	—		56,757
4		手法及び方針	—	—	—	—		—
5		買収及び売却	—	—	—	—		—
6		為替の変動	△34,698	△20,245	△38,152	△2,448		△95,545
7		その他	—	—	—	—		—
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	1,451,637	846,990	1,596,157	102,439		3,997,224	
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	0.74	1.04	1.00	1.00		0.92	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,086,312	881,285	1,596,157	102,439		3,666,194	

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
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	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
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1回任意償還条項付無担保永久社債 （債務免除特約及び劣後特約付・適格機関投資家限定）
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(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 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、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： 年3.36パーセント 2021年6月15日の翌日以降： 6か月物ユーロ円LIBOR + 3.20パーセント
19	配当等停止条項の有無(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 (ii) 実質破綻事由：内閣総理大臣が、発行者について、預金保険法に定める特定第二号措置を講ずる必要がある旨の特定認定を行った場合 (iii) 倒産手続開始事由：発行者につき倒産手続開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲(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
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）
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 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： 年1.80パーセント 2025年7月18日の翌日以降： 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 (ii) 実質破綻事由：内閣総理大臣が、発行者について、預金保険法に定める特定第二号措置を講ずる必要がある旨の特定認定を行った場合 (iii) 倒産手続開始事由：発行者につき倒産手続開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲(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. 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	株式会社杉村倉庫、Nomura Asset Management Taiwan Ltd. 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	日本法、香港法 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 Tier 2 資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier 1 資本に係る基礎項目の額 Tier 2 資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(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	2,084百万円
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 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年12月末	2020年9月末
オン・バランス資産の額(1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	23,966,030	22,936,246
1 a	1	連結貸借対照表における総資産の額	42,677,216	40,032,489
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)	231,040	123,476
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(△)	18,480,145	16,972,766
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	164,669	169,979
3		オン・バランス資産の額(イ)	23,801,360	22,766,266
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	1,831,023	1,578,602
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	4,411,825	4,180,166
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	1,438,022	1,591,879
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(△)	1,251,050	1,592,861
8		清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)		
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	15,663,439	17,050,725
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(△)	14,601,393	15,666,699
11	4	デリバティブ取引等に関する額(ロ)	7,491,866	7,141,813
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	36,213,271	31,624,973
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	19,260,944	16,059,025
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	1,611,793	1,155,218
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額(ハ)	18,564,119	16,721,166

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年12月末	2020年9月末
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	4,272,567	3,122,898
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(△)	1,567,327	1,021,062
19	6	オフ・バランス取引に関する額(二)	2,705,240	2,101,835
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額(ホ)	2,952,884	2,855,329
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	52,562,587	48,731,083
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.61%	5.85%
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)	52,562,587	48,731,083
		日本銀行に対する預け金の額	1,915,028	2,651,947
		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')	54,477,616	51,383,030
		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'))	5.42%	5.55%

(注)

- 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。

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 (2021年3月期 第3 四半期)		前最終指定親会社四半期 (2021年3月期 第2 四半期)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	5,644,880		5,888,043	
資金流出額 (2)		資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額	資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	513,871	61,762	508,210	61,984
3	うち、安定預金の額	—	—	—	—
4	うち、準安定預金の額	513,871	61,762	508,210	61,984
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,747,768	1,538,463	1,627,406	1,443,713
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性 有価証券以外のホールセール無担保資金調達 に係る資金の額	1,192,231	982,925	1,165,639	981,946
8	うち、負債性有価証券の額	555,538	555,538	461,767	461,767
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,816,292		2,701,751
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与 信・流動性ファシリティに係る資金流出額	2,344,109	1,983,610	2,130,152	1,784,425
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,863,447	1,863,447	1,662,819	1,662,819
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金 流出額	480,662	120,162	467,333	121,606
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,968,954	901,927	3,473,426	914,888
15	偶発事象に係る資金流出額	422,829	193,816	406,970	186,239
16	資金流出合計額		7,495,869		7,092,999
資金流入額 (3)		資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額	資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	28,745,297	1,983,140	27,544,297	2,015,713
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	992,719	901,934	1,059,813	979,739
19	その他資金流入額	4,730,737	2,091,983	4,045,601	1,713,062
20	資金流入合計額	34,468,753	4,977,056	32,649,710	4,708,513
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		5,644,880		5,888,043
22	純資金流出額		2,519,111		2,384,486
23	連結流動性カバレッジ比率		231.5%		248.4%
24	平均値計算用データ数	63		61	

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。

