2021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　2021年４月１日
（第118期）　　至　2021年９月30日

野村ホールディングス株式会社

目次

第１部　連結自己資本規制に関する開示 3
第１章　自己資本の構成に関する開示事項 4
第２章　定性的な開示事項 14
第３章　定量的な開示事項 18
第４章　自己資本調達手段に関する契約内容 55
第５章　自己資本調達手段に関する契約内容（その他外部 TLAC 調達手段の概要） 65
第６章　連結レバレッジ比率に関する開示事項 80
第７章　TLAC 規制 82
第２部　連結流動性規制に関する開示 89
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 90
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 91
第３章　連結安定調達比率に関する定量的開示事項 92
第４章　連結安定調達比率に関する定性的開示事項 94
第３部　開示方針 95

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
		2021年９月末	2021年６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	2,759,588	2,773,766	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	1,279,215	1,271,968	1a
2	うち、利益剰余金の額	1,554,693	1,576,694	2
1c	うち、自己株式の額（△）	74,320	74,896	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	△28,505	△37,175	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）	2,731,082	2,736,591	
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	104,602	104,424	
8	うち、のれんに係るもの（のれん相当差額を含む。）の額	13,495	13,357	
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	91,107	91,066	
10	繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）の額	4,493	4,069	
11	繰延ヘッジ損益の額	－	－	
12	適格引当金不足額	5,554	11,169	
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	2,415	△2,604	
15	退職給付に係る資産の額	9,090	9,184	
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	2,219	1,429	
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
			2021年９月末	2021年６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）	128,376	127,672	
普通株式等Tier1　資本					
29		普通株式等Tier1　資本の額((イ)－(ロ))　（ハ）	2,602,705	2,608,919	
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	375,000	374,800	
		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	1,622	3,062	
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）	376,622	377,862	

（単位：百万円、％）

国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2021年９月末	2021年６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)	376,622	377,862	
Tier1　資本				
45	Tier1　資本の額((ハ)＋(ヘ))　(ト)	2,979,328	2,986,781	
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	381	720	
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	3,950	3,950	
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	3,950	3,950	
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)	4,331	4,670	

（単位：百万円、%）

国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2021年９月末	2021年６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)	4,331	4,670	
総自己資本				
59	総自己資本の合計((ト)＋(ヌ))　(ル)	2,983,660	2,991,452	
リスク・アセット(6)				
60	リスク・アセットの額　(ヲ)	14,703,195	14,714,452	
連結自己資本規制比率及び資本バッファー(7)				
61	連結普通株式等Tier1　比率((ハ)／(ヲ))	17.70%	17.73%	
62	連結Tier1　比率((ト)／(ヲ))	20.26%	20.29%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))	20.29%	20.33%	
64	最低連結資本バッファー比率	3.02%	3.02%	
65	うち、資本保全バッファー比率	2.50%	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.02%	0.02%	
67	うち、G-SIB/D-SIB　バッファー比率	0.50%	0.50%	
68	連結資本バッファー比率	12.29%	12.33%	
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	169,917	173,849	
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	179,282	173,566	
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	12,338	12,948	

（単位：百万円、%）

国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2021年９月末	2021年６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	3,950	3,950	
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。）	28,887	30,877	

（単位：百万円、%）

自己資本の構成		
国際様式の該当番号	項目	2020年９月末
普通株式等Tier1　資本に係る基礎項目(1)		
1a＋2－1c－26	普通株式に係る株主資本の額	2,816,950
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	1,277,726
2	うち、利益剰余金の額	1,772,538
1c	うち、自己株式の額（△）	233,314
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
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
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	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	12,445
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	94,146
10	繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）の額	4,501
11	繰延ヘッジ損益の額	－
12	適格引当金不足額	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	20,552
15	前払年金費用の額	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	1,750
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	2020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）	190,532
普通株式等Tier1　資本			
29		普通株式等Tier1　資本の額((イ)－(ロ))　　（ハ）	2,537,712
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	－
	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
		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	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）	317,617

（単位：百万円、%）

国際様式の該当番号	項目	2020年９月末
その他Tier1　資本に係る調整項目		
37	自己保有その他Tier1　資本調達手段の額	－
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1　資本調達手段の額	－
39	少数出資金融機関等のその他Tier1　資本調達手段の額	－
40	その他金融機関等のその他Tier1　資本調達手段の額	－
42	Tier2　資本不足額	－
43	その他Tier1　資本に係る調整項目の額　（ホ）	－
その他Tier1　資本		
44	その他Tier1　資本の額((ニ)－(ホ))　（ヘ）	317,617
45	Tier1　資本の額((ハ)＋(ヘ))　（ト）	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	－
	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	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	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
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）	31,055

（単位：百万円、%）

国際様式の該当番号	項目	2020年９月末
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)	31,055
総自己資本		
59	総自己資本の合計((ト)＋(ヌ))　(ル)	2,886,385
リスク・アセット(6)		
60	リスク・アセットの額　(ヲ)	15,037,167
連結自己資本規制比率及び資本バッファー(7)		
61	連結普通株式等Tier1　比率((ハ)／(ヲ))	16.87%
62	連結Tier1　比率((ト)／(ヲ))	18.98%
63	連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))	19.19%
64	最低連結資本バッファー比率	3.01%
65	うち、資本保全バッファー比率	2.50%
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.01%
67	うち、G-SIB/D-SIB　バッファー比率	0.50%
68	連結資本バッファー比率	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	149,595
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	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	4,838

（単位：百万円、%）

国際様式の該当番号	項目	2020年９月末
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	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

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

2021年９月末において、野村證券株式会社（日本・証券業）、ノムラ・インターナショナルPLC（英国・証券業）、ノムラ・セキュリティーズ・インターナショナルInc.（米国・証券業）、ノムラ・インターナショナル（ホンコン）LIMITED（香港・証券業）、野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービシズ株式会社（日本・証券業）など183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、2021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936億円、純資産18億円）、
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13億円、純資産13億円）、
Nomura Americas Re Ltd.　（バミューダ、保険業、総資産2,013億円、純資産61億円）、
Nomura Americas US Re Ltd.　（バミューダ、保険業、総資産33億円、純資産33億円）、
その他VIE1,134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

2021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	3,836,087	3,816,572	
定期預金	342,778	342,778	
取引所預託金およびその他の顧客分別金	312,578	312,578	
貸付金	3,143,346	2,972,944	
顧客に対する受取債権	486,602	486,505	
顧客以外に対する受取債権	761,126	754,931	
貸倒引当金	△61,709	△61,709	
売戻条件付買入有価証券	11,272,572	11,272,572	
借入有価証券担保金	4,658,853	4,658,853	
トレーディング資産	16,333,622	15,366,787	
プライベート・エクイティ投資	77,820	73,289	
建物、土地、器具備品および設備	460,051	403,768	
トレーディング目的以外の負債証券	444,122	449,208	
投資持分証券	135,959	135,959	
関連会社に対する投資および貸付金	358,878	358,878	
その他	783,861	782,991	
資産の部合計	43,346,551	42,126,909	
負債の部			
短期借入	1,188,793	1,021,216	
顧客に対する支払債務	1,469,025	1,469,025	
顧客以外に対する支払債務	1,793,856	1,793,769	
受入銀行預金	1,463,647	1,463,647	
買戻条件付売却有価証券	13,463,321	13,573,001	
貸付有価証券担保金	1,515,820	1,521,837	
その他の担保付借入	380,785	380,785	
トレーディング負債	9,645,763	9,716,496	
その他の負債	927,955	988,865	
長期借入	8,695,951	7,909,990	
負債の部合計	40,544,920	39,838,636	
純資産の部			
資本金	594,492	594,492	1a
資本剰余金	684,722	684,722	1a
利益剰余金	1,557,696	1,553,818	2
累積的その他の包括利益	△28,505	△28,505	3
自己株式	△74,320	△74,320	1c
非支配持分	67,545	67,545	
純資産の部合計	2,801,631	2,797,753	
負債及び純資産の部合計	43,346,552	42,636,389	

2021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 公表 連結貸借対照表	ロ 規制上の連結範囲に基づく連結貸借対照表	ハ 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	3,230,541	3,195,834	
定期預金	345,724	345,724	
取引所預託金およびその他の顧客分別金	319,257	319,257	
貸付金	2,867,031	2,776,428	
顧客に対する受取債権	452,253	452,152	
顧客以外に対する受取債権	1,011,570	1,007,862	
貸倒引当金	△61,418	△61,418	
売戻条件付買入有価証券	11,381,727	11,381,727	
借入有価証券担保金	4,666,007	4,666,007	
トレーディング資産	15,277,366	14,348,638	
プライベート・エクイティ投資	74,345	68,589	
建物、土地、器具備品および設備	466,516	410,252	
トレーディング目的以外の負債証券	416,990	421,960	
投資持分証券	131,007	131,007	
関連会社に対する投資および貸付金	356,308	356,308	
その他	894,973	894,558	
資産の部合計	41,830,203	40,714,892	
負債の部			
短期借入	1,500,333	1,364,932	
顧客に対する支払債務	1,432,935	1,432,935	
顧客以外に対する支払債務	1,303,771	1,303,722	
受入銀行預金	1,400,598	1,400,598	
買戻条件付売却有価証券	12,875,394	12,976,232	
貸付有価証券担保金	1,112,933	1,118,911	
その他の担保付借入	421,679	421,679	
トレーディング負債	9,913,220	9,978,553	
その他の負債	949,682	1,010,978	
長期借入	8,115,333	7,382,745	
負債の部合計	39,025,883	38,391,287	
純資産の部			
資本金	594,492	594,492	1a
資本剰余金	677,475	677,475	1a
利益剰余金	1,579,329	1,576,001	2
累積的その他の包括利益	△37,175	△37,175	3
自己株式	△74,896	△74,896	1c
非支配持分	65,093	65,093	
純資産の部合計	2,804,320	2,800,992	
負債及び純資産の部合計	41,830,203	41,192,280	

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 公表 連結貸借対照表	ロ 規制上の連結範囲に基づく連結貸借対照表	ハ 別紙様式第一号（自己資本の構成）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
累積的その他の包括利益	△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．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 2021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）	5,778
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（マンデート方式）	－
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％）	55,886
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％）	8,820

（単位：百万円）

	エクスポージャーの額 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（マンデート方式）	－
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

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						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2021年９月末	2021年６月末	2021年３月末	2020年12月末	2020年９月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,602,705	2,608,919	2,522,134	2,636,197	2,537,712
2	Tier1資本の額	2,979,328	2,986,781	2,840,505	2,952,884	2,855,329
3	総自己資本の額	2,983,660	2,991,452	2,845,248	2,961,181	2,886,385
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	14,703,195	14,714,452	15,951,006	14,974,069	15,037,167
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	17.70%	17.73%	15.81%	17.60%	16.87%
6	連結Tier1比率	20.26%	20.29%	17.80%	19.71%	18.98%
7	連結総自己資本比率	20.29%	20.33%	17.83%	19.77%	19.19%
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	0.02%	0.02%	0.02%	0.01%	0.01%
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	3.02%	3.02%	3.02%	3.01%	3.01%
12	連結資本バッファー比率	12.29%	12.33%	9.83%	11.77%	11.19%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	50,441,867	49,451,215	50,437,139	52,562,587	48,731,083
14	連結レバレッジ比率	5.90%	6.03%	5.63%	5.61%	5.85%

（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
		2022年３月期第２四半期	2022年３月期第１四半期	2021年３月期第４四半期	2021年３月期第３四半期	2021年３月期第２四半期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	6,024,539	5,451,717	5,437,099	5,644,880	5,888,043
16	純資金流出額	2,219,276	2,538,263	2,844,745	2,519,111	2,384,486
17	連結流動性カバレッジ比率	272.8%	216.0%	192.4%	231.5%	248.4%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	13,089,893				
19	所要安定調達額	11,149,781				
20	連結安定調達比率	117.4%				

KM２：主要な指標（TLAC要件）

（単位：百万円、％）

KM２：主要な指標（TLAC要件）						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2021年９月末	2021年６月末	2021年３月末	2020年12月末	2020年９月末
1	外部TLACの額	4,766,941	4,281,520	4,160,244		
2	リスク・アセットの額	14,703,195	14,714,452	15,951,006		
3	資本バッファー勘案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率	32.42%	29.09%	26.08%		
3a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	29.40%	26.07%	23.06%		
4	総エクスポージャーの額	50,441,867	49,451,215	50,437,139		
5	総エクスポージャーベース外部TLAC比率	9.45%	8.65%	8.24%		
6a	法令の規定に基づいて除外債務がベイルインの対象から除外される法域か否か					
6b	特例外部TLAC調達手段が認められる法域か否か					
6c	特例外部TLAC調達手段のうちその他外部TLAC調達手段に相当するとして認められているものが占める割合					

(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	
		2021年９月末	2021年６月末	2021年９月末	2021年６月末
1	信用リスク	1,477,401	1,460,261	122,319	120,942
2	うち、標準的手法適用分	276,798	255,730	22,143	20,458
3	うち、内部格付手法適用分	859,847	858,553	72,915	72,805
	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	340,756	345,977	27,260	27,678
4	カウンターパーティ信用リスク	3,273,676	3,287,474	270,091	271,253
5	うち、SA-CCR適用分	528,040	496,652	44,619	41,978
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,025,458	1,055,602	86,958	89,515
	うち、CVAリスク	1,191,183	1,215,027	95,294	97,202
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	341,220	321,876	27,297	25,750
	その他	187,773	198,315	15,920	16,808
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	1,862,663	1,858,974	157,953	157,641
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）	72,225	87,462	6,124	7,416
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（マンデート方式）	—	—	—	—
	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%）	223,546	234,489	18,956	19,884
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%）	110,254	140,037	8,820	11,203
11	未決済取引	6,124	13,436	502	1,090
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	4,352,557	4,403,775	348,204	352,302
17	うち、標準的方式適用分	795,254	747,072	63,620	59,765
18	うち、内部モデル方式適用分	3,557,302	3,656,703	284,584	292,536
19	オペレーショナル・リスク	2,533,229	2,448,517	202,658	195,881
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	2,533,229	2,448,517	202,658	195,881
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	479,054	466,288	40,623	39,541
	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)	14,703,195	14,714,452	1,176,255	1,177,156

（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	
		2021年９月末	2020年９月末	2021年９月末	2020年９月末
1	信用リスク	1,477,401	1,442,683	122,319	119,290
2	うち、標準的手法適用分	276,798	243,181	22,143	19,454
3	うち、内部格付手法適用分	859,847	807,566	72,915	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	340,756	391,935	27,260	31,354
4	カウンターパーティ信用リスク	3,273,676	3,559,438	270,091	293,532
5	うち、SA-CCR適用分	528,040	535,649	44,619	45,358
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,025,458	1,161,606	86,958	98,504
	うち、CVAリスク	1,191,183	1,377,588	95,294	110,207
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	341,220	339,502	27,297	27,160
	その他	187,773	145,091	15,920	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	1,862,663	1,881,909	157,953	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）	72,225	84,100	6,124	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（マンデート方式）	—	—	—	—
	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%）	223,546	222,643	18,956	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%）	110,254	154,347	8,820	12,347
11	未決済取引	6,124	6,049	502	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	4,352,557	4,452,722	348,204	356,217
17	うち、標準的方式適用分	795,254	700,344	63,620	56,027
18	うち、内部モデル方式適用分	3,557,302	3,752,378	284,584	300,190
19	オペレーショナル・リスク	2,533,229	2,578,119	202,658	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	2,533,229	2,578,119	202,658	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	479,054	344,887	40,623	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)	14,703,195	15,037,167	1,176,255	1,202,973

(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

2021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（イ＋ロ－ハ）
		デフォルトしたエクスポージャー	非デフォルトエクスポージャー		
	オン・バランスシートの資産				
1	貸出金	53,276	722,187	53,276	722,187
2	有価証券（うち負債性のもの）	－	－	－	－
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	－	－	－	－
4	オン・バランスシートの資産の合計（1＋2＋3）	53,276	722,187	53,276	722,187
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	－	19,617	－	19,617
6	コミットメント等	－	93,738	－	93,738
7	オフ・バランスシートの資産の合計（5＋6）	－	113,355	－	113,355
	合計				
8	合計（4＋7）	53,276	835,543	53,276	835,543

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（イ＋ロ－ハ）
		デフォルトしたエクスポージャー	非デフォルトエクスポージャー		
	オン・バランスシートの資産				
1	貸出金	－	595,443	－	595,443
2	有価証券（うち負債性のもの）	－	－	－	－
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	－	－	－	－
4	オン・バランスシートの資産の合計（1＋2＋3）	－	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合計（5＋6）	－	87,214	－	87,214
	合計				
8	合計（4＋7）	－	682,658	－	682,658

（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

2021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		197,859
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	144,583
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）		53,276

CR３：信用リスク削減手法

2021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
		非保全エクスポージャー	保全されたエクスポージャー	担保で保全されたエクスポージャー	保証で保全されたエクスポージャー	クレジット・デリバティブで保全されたエクスポージャー
1	貸出金	278,651	443,536	443,536	－	－
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）	278,651	443,536	443,536	－	－
5	うちデフォルトしたもの	53,276	－	－	－	－

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
		非保全エクスポージャー	保全されたエクスポージャー	担保で保全されたエクスポージャー	保証で保全されたエクスポージャー	クレジット・デリバティブで保全されたエクスポージャー
1	貸出金	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	－	－	－	－	－

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

2021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		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）
	資産クラス	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	6,667	－	6,667	－	0	0.00%
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	5,411	－	5,411	－	555	10.26%
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	47	－	47	－	13	29.15%
7	国際開発銀行向け	11	－	11	－	0	0.00%
8	地方公共団体金融機構向け	－	－	－	－	－	－
9	我が国の政府関係機関向け	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	34,402	－	34,402	－	9,075	26.37%
12	法人等向け	707,117	－	263,580	－	263,458	99.95%
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。）	2,463	－	2,463	－	3,694	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	756,121	－	312,585	－	276,798	88.55%

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％

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

2021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／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	6,667	－	－	－	－	－	－	－	－	－	6,667
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	4,286	－	23	－	1,101	－	－	－	－	－	5,411
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	－	－	41	－	－	－	5	－	－	－	47
7	国際開発銀行向け	11	－	－	－	－	－	－	－	－	－	11
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	－	－	30,133	－	2,440	－	1,828	－	－	－	34,402
12	法人等向け	－	－	20	－	210	－	263,349	－	－	－	263,580
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。）	－	－	－	－	－	－	－	2,463	－	－	2,463
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	10,965	0	30,220	－	3,752	－	265,182	2,463	－	－	312,585

2020年９月末　　（単位：百万円）

CR５：標準的手法ー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	資産クラス＼リスク・ウェイト	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

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

2021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

		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
	ソブリン向けエクスポージャー												
1	0.00以上0.15未満	3,078,001	－	－	3,078,001	0.00%	100件未満	45.00%	1.0	1,606	0.05%	0	
2	0.15以上0.25未満	18	－	－	18	0.19%	100件未満	45.00%	1.0	5	29.33%	0	
3	0.25以上0.50未満	732	－	－	732	0.30%	100件未満	45.00%	1.0	283	38.71%	0	
4	0.50以上0.75未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	0	
5	0.75以上2.50未満	34	－	－	34	0.88%	100件未満	45.00%	1.0	23	69.22%	0	
6	2.50以上10.00未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
7	10.00以上100.00未満	10	－	－	10	29.00%	100件未満	45.00%	1.0	24	235.83%	1	
8	100.00（デフォルト）	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
9	小計	3,078,798	－	－	3,078,798	0.00%	100件未満	45.00%	1.0	1,944	0.06%	3	－
	金融機関等向けエクスポージャー												
1	0.00以上0.15未満	1,228,064	－	－	1,228,064	0.05%	0.2	45.00%	1.3	223,328	18.18%	284	
2	0.15以上0.25未満	39,424	－	－	39,424	0.19%	100件未満	45.00%	3.4	20,943	53.12%	34	
3	0.25以上0.50未満	35,435	－	－	35,435	0.28%	100件未満	45.00%	1.2	18,162	51.25%	45	
4	0.50以上0.75未満	3,971	－	－	3,971	0.60%	100件未満	45.00%	4.7	4,231	106.56%	10	
5	0.75以上2.50未満	2,333	－	－	2,333	1.53%	100件未満	45.00%	3.7	2,859	122.53%	16	
6	2.50以上10.00未満	2,397	－	－	2,397	4.98%	100件未満	45.00%	4.6	4,245	177.04%	53	
7	10.00以上100.00未満	10,353	－	－	10,353	29.00%	100件未満	45.00%	1.7	25,545	246.74%	1,351	
8	100.00（デフォルト）	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
9	小計	1,321,980	－	－	1,321,980	0.30%	0.3	45.00%	1.4	299,316	22.64%	1,796	－
	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	150,927	1,113	100.00%	152,040	0.05%	0.2	45.00%	2.5	44,480	29.25%	38	
2	0.15以上0.25未満	1,951	－	－	1,951	0.19%	100件未満	45.00%	3.8	1,205	61.77%	1	
3	0.25以上0.50未満	9,141	－	－	9,141	0.31%	100件未満	45.00%	4.9	9,732	106.46%	13	
4	0.50以上0.75未満	1,660	－	－	1,660	0.60%	100件未満	45.00%	1.9	1,270	76.49%	4	
5	0.75以上2.50未満	2,866	－	－	2,866	0.98%	100件未満	45.00%	2.7	2,880	100.48%	12	
6	2.50以上10.00未満	1,577	－	－	1,577	4.17%	100件未満	45.00%	1.1	1,995	126.49%	29	
7	10.00以上100.00未満	85,462	18,503	100.00%	103,966	29.00%	0.6	45.00%	2.6	288,706	277.69%	13,568	
8	100.00（デフォルト）	54,472	－	－	54,472	100.00%	100件未満	45.00%	4.9	－	－	24,512	53,276
9	小計	308,060	19,617	100.00%	327,677	25.89%	0.9	45.00%	3.0	350,271	106.89%	38,181	53,276
	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	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－

2021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

		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
	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	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－

2021年９月末　　（単位：百万円、％、千件、年）

CR６：内部格付手法ーポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
	その他リテール向けエクスポージャー												
1	0.00以上0.15未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
2	0.15以上0.25未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
3	0.25以上0.50未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
4	0.50以上0.75未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
5	0.75以上2.50未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
6	2.50以上10.00未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
7	10.00以上100.00未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
8	100.00（デフォルト）	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
9	小計	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
合計（全てのポートフォリオ）		4,708,838	19,617	100.00％	4,728,455	1.87％	1.3	45.00％	1.3	651,531	13.77％	39,980	53,276

2020年９月期　　（単位：百万円、％、千件、年）

CR６：内部格付手法ーポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー

		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
	ソブリン向けエクスポージャー												
1	0.00以上0.15未満	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	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－

2020年９月期　　（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

		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
	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	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－

2020年９月期　　（単位：百万円、％、千件、年）

CR６：内部格付手法ーポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
	その他リテール向けエクスポージャー												
1	0.00以上0.15未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
2	0.15以上0.25未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
3	0.25以上0.50未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
4	0.50以上0.75未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
5	0.75以上2.50未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
6	2.50以上10.00未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
7	10.00以上100.00未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
8	100.00（デフォルト）	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	
9	小計	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
合計（全てのポートフォリオ）		4,671,182	14,592	100.00％	4,685,774	0.60％	2.0	45.00％	1.2	594,850	12.69％	12,787	－

（注）

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

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

2021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・デリバティブ勘案前の信用リスク・アセットの額	実際の信用リスク・アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー－FIRB	1,944	1,944
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	299,316	299,316
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	350,271	350,271
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	651,531	651,531

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・デリバティブ勘案前の信用リスク・アセットの額	実際の信用リスク・アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー－FIRB	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

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（2021年６月末）における信用リスク・アセットの額		3,507,288
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△5,463
3		ポートフォリオの質	14,595
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	3,072
8		その他	－
9	当四半期末時点（2021年９月末）における信用リスク・アセットの額		3,519,492

（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）

2021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	36,570	16,520	50.00%	27,364	－	－	21,597	48,961	24,480	－
	2.5年以上	56,074	29,239	70.00%	62,118	－	－	15,885	78,004	54,602	312
良（Good）	2.5年未満	49,815	25,647	70.00%	10,164	－	－	58,885	69,050	48,335	276
	2.5年以上	52,034	21,788	90.00%	50,658	－	－	17,717	68,376	61,538	547
可（Satisfactory）		14,953	542	115.00%	7,590	－	－	7,769	15,360	17,664	430
弱い（Weak）		677	－	250.00%	－	－	－	677	677	1,694	54
デフォルト（Default）		－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
合計		210,126	93,738	－	157,896	－	－	122,533	280,430	208,315	1,619
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）											
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト					エクスポージャーの額（EAD）	信用リスク・アセットの額	期待損失
優（Strong）	2.5年未満	－	－	－					－	－	－
	2.5年以上	－	－	－					－	－	－
良（Good）	2.5年未満	－	－	－					－	－	－
	2.5年以上	－	－	－					－	－	－
可（Satisfactory）		－	－	－					－	－	－
弱い（Weak）		－	－	－					－	－	－
デフォルト（Default）		－	－	－					－	－	－
合計		－	－	－					－	－	－
株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）											
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー											
カテゴリー		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト					エクスポージャーの額（EAD）	信用リスク・アセットの額	
簡易手法－上場株式		434,295	－	300.00%					434,295	1,302,887	
簡易手法－非上場株式		139,944	－	400.00%					139,944	559,776	
内部モデル手法		－	－	－					－	－	
合計		574,239	－	－					574,239	1,862,663	
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%					－	－	

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	
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%					－	－	

(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

2021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α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR	185,064	455,417		1.4	944,749	528,040
2	期待エクスポージャー方式			3,703,878	1.4	5,289,039	1,025,458
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					4,248,226	187,773
5	エクスポージャー変動推計モデル					－	－
6	合計						1,741,272

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
		再構築コスト	アドオン	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用されるα	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR	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

CCR２：CVAリスクに対する資本賦課

2021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適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額（CVAリスク相当額を８％で除して得た額）
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	2,900,233	857,553
2	（ⅰ）CVAバリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）		526,600
3	（ⅱ）CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）		330,953
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	944,749	333,629
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	3,844,982	1,191,183

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適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額（CVAリスク相当額を８％で除して得た額）
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	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

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

2021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／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	369	－	73,344	115	－	6	－	－	73,835
3	国際決済銀行等向け	2	－	－	－	－	－	－	－	2
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	21	－	－	－	－	－	－	－	21
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	－	－	6,845	9	－	5	－	－	6,860
11	法人等向け	－	－	－	－	－	17,425	－	－	17,425
12	中小企業等向け及び個人向け	－	－	－	－	－	－	－	－	－
13	上記以外	－	－	－	－	－	－	－	－	－
14	合計	393	－	80,189	125	－	17,437	－	－	98,146

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／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

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

2021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		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
	PD区分	EAD（信用リスク削減効果勘案後）	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）
	ソブリン向けエクスポージャー							
1	0.00以上0.15未満	1,491,063	－	0.1	44.39%	0.5	19,049	1.27%
2	0.15以上0.25未満	6,437	0.19%	100件未満	45.00%	0.9	1,854	28.80%
3	0.25以上0.50未満	14,850	0.30%	100件未満	45.00%	0.6	5,270	35.49%
4	0.50以上0.75未満	547	0.60%	100件未満	45.00%	0.0	314	57.55%
5	0.75以上2.50未満	33,771	0.89%	100件未満	45.00%	0.8	22,690	67.18%
6	2.50以上10.00未満	－	－	－	－	－	－	－
7	10.00以上100.00未満	4	29.00%	100件未満	45.00%	0.0	9	231.33%
8	100.00（デフォルト）	－	－	－	－	－	－	－
9	小計	1,546,673	0.03%	0.1	44.41%	0.5	49,188	3.18%
	金融機関等向けエクスポージャー							
1	0.00以上0.15未満	3,500,887	0.05%	0.3	26.50%	0.8	312,084	8.91%
2	0.15以上0.25未満	244,324	0.19%	100件未満	35.46%	1.3	72,576	29.70%
3	0.25以上0.50未満	161,558	0.34%	0.1	20.46%	1.0	30,967	19.16%
4	0.50以上0.75未満	131,205	0.60%	100件未満	9.65%	0.7	23,736	18.09%
5	0.75以上2.50未満	157,304	1.70%	100件未満	9.62%	0.9	30,421	19.33%
6	2.50以上10.00未満	138,729	4.69%	100件未満	7.36%	1.8	30,347	21.87%
7	10.00以上100.00未満	10,331	29.00%	100件未満	45.00%	0.9	25,797	249.70%
8	100.00（デフォルト）	165	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	0	0.00%
9	小計	4,344,505	0.36%	0.8	25.09%	0.9	525,930	12.10%
	事業法人向けエクスポージャー							
1	0.00以上0.15未満	2,460,880	0.05%	5.1	35.90%	1.0	311,538	12.65%
2	0.15以上0.25未満	314,545	0.19%	0.6	44.96%	1.1	113,057	35.94%
3	0.25以上0.50未満	321,536	0.31%	0.4	43.92%	1.2	162,933	50.67%
4	0.50以上0.75未満	616,780	0.60%	0.2	8.13%	0.2	81,900	13.27%
5	0.75以上2.50未満	421,976	1.13%	0.3	19.12%	0.6	168,752	39.99%
6	2.50以上10.00未満	206,718	6.57%	0.3	19.21%	0.5	129,717	62.75%
7	10.00以上100.00未満	148,295	29.00%	1.4	19.32%	0.4	164,713	111.07%
8	100.00（デフォルト）	1,958	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	0	0.00%
9	小計	4,492,690	1.56%	8.6	30.41%	0.8	1,132,614	25.21%
合計（全てのポートフォリオ）		10,383,869	0.83%	9.6	30.27%	0.8	1,707,733	16.44%

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		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
	PD区分	EAD（信用リスク削減効果勘案後）	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）
	ソブリン向けエクスポージャー							
1	0.00以上0.15未満	1,082,538	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%

（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

2021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）	－	828,077	－	1,506,741	1,856,909	3,668,418
2	現金（外国通貨）	3,238	2,093,555	－	986,694	34,107,837	34,238,095
3	国内ソブリン債	68,940	163,305	542,757	65,450	4,004,856	1,992,833
4	その他ソブリン債	274,294	216,599	26,691	110,234	27,258,917	21,621,270
5	政府関係機関債	－	14,156	628	－	345,090	108,206
6	社債	45,214	101,078	7,245	19,094	8,526,461	22,798,775
7	株式	166,025	487,822	2,627	410,569	3,217,657	4,130,739
8	その他担保	705	13,058	－	－	3,871	22,800
9	合計	558,418	3,917,654	579,951	3,098,784	79,321,602	88,581,140

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

CCR６：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

2021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	7,048,918	7,037,006
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	9,904,873	10,825,939
3	トータル・リターン・スワップ	1,532,540	472,612
4	クレジットオプション	7,706	6,910
5	その他のクレジット・デリバティブ	－	－
6	想定元本合計	18,494,039	18,342,468
	公正価値		
7	プラスの公正価値（資産）	29,841	327,738
8	マイナスの公正価値（負債）	△340,403	△10,177

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

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（2021年６月末）における信用リスク・アセットの額		1,055,602
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△15,772
3		取引相手方の信用力	△23,926
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）	61
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	10,229
8		その他	△736
9	当四半期末時点（2021年９月末）における信用リスク・アセットの額		1,025,458

CCR８：中央清算機関向けエクスポージャー

2021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）		126,377
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	3,591,386	71,827
3	（ｉ）派生商品取引（上場以外）	2,752,012	55,040
4	（ⅱ）派生商品取引（上場）	445,738	8,914
5	（ⅲ）レポ形式の取引	393,635	7,872
6	（ⅳ）クロスプロダクト・ネッティングが承認された場合のネッティング・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	439,390	8,787
9	事前拠出された清算基金	153,784	45,761
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）		214,843
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。）	153,516	126,053
13	（ｉ）派生商品取引（上場以外）	47,630	47,630
14	（ⅱ）派生商品取引（上場）	65,033	65,033
15	（ⅲ）レポ形式の取引	40,852	13,389
16	（ⅳ）クロスプロダクト・ネッティングが承認された場合のネッティング・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	66,426	66,402
19	事前拠出された清算基金	1,790	22,386
20	未拠出の清算基金	－	－

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・ネッティングが承認された場合のネッティング・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・ネッティングが承認された場合のネッティング・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	－	－

(5) 証券化エクスポージャーに関する事項

SEC１：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。

SEC２：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。）

2021年９月末　（単位：百万円）

SEC２：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）	－	－	－	19,411	－	19,411	47,833	－	47,833
2	担保付住宅ローン	－	－	－	16,019	－	16,019	43,372	－	43,372
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	－	－	－	3,391	－	3,391	4,457	－	4,457
5	再証券化	－	－	－	－	－	－	3	－	3
6	ホールセール（合計）	－	－	－	－	－	－	29,119	－	29,119
7	事業法人向けローン	－	－	－	－	－	－	28,031	－	28,031
8	商業用モーゲージ担保証券	－	－	－	－	－	－	642	－	642
9	リース債権及び売掛債権	－	－	－	－	－	－	445	－	445
10	その他のホールセール	－	－	－	－	－	－	－	－	－
11	再証券化	－	－	－	－	－	－	－	－	－

2020年９月末　（単位：百万円）

SEC２：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	－	－	－	－	－	－	－	－	－

SEC３：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。

SEC４：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

MR１：標準的方式によるマーケット・リスク相当額

（単位：百万円）

MR１：標準的方式によるマーケット・リスク相当額			
項番		リスク・アセット（リスク相当額を８パーセントで除して得た額）	
		2021年９月末	2020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	795,254	700,344
9	合計	795,254	700,344

MR２：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）

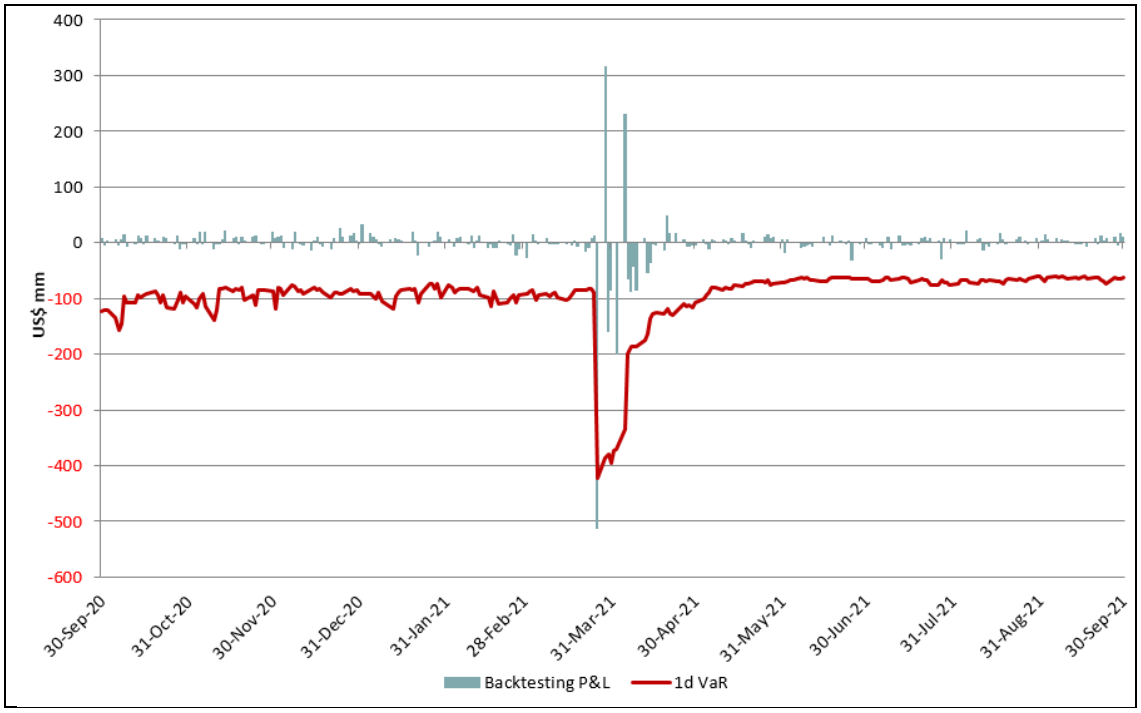
MR２：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因								
項番			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
			バリュー・アット・リスク	ストレス・バリュー・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計
1a	前四半期末（2021年６月末）におけるリスク・アセット		1,258,146	917,731	1,371,216	109,607		3,656,703
1b	前四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整		1.63	1.09	1.04	1.00		1.16
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額		768,737	835,769	1,312,655	109,607		3,026,770
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	752,461	18,405	392,433	△62		1,163,239
3		モデルの更新又は変更	△10,726	17,583	43,711	－		50,568
4		手法及び方針	－	－	－	－		－
5		買収及び売却	－	－	－	－		－
6		為替の変動	17,452	10,072	20,206	1,265		48,997
7		その他	－	－	－	－		－
8a	当四半期末（2021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		1,527,926	881,831	1,769,006	110,811		4,289,575
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		0.60	0.85	1.00	1.00		0.85
8c	当四半期末のおけるリスク・アセット		923,992	753,491	1,769,006	110,811		3,557,302

MR３：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）

（単位：百万円）

MR３：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）			
項番		2021年９月末	2020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	120,352	120,049
2	平均値	29,803	45,817
3	最小値	18,095	15,717
4	期末	40,745	46,083
	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	53,332	66,824
6	平均値	23,051	29,395
7	最小値	15,111	17,911
8	期末	23,516	26,008
	追加的リスクの額（片側信頼区間99.9%）		
9	最大値	141,521	233,100
10	平均値	114,684	136,107
11	最小値	107,258	108,728
12	期末	141,521	108,728
	包括的リスクの額（片側信頼区間99.9%）		
13	最大値	9,869	10,068
14	平均値	8,809	8,720
15	最小値	8,349	7,182
16	期末	8,865	9,733
17	フロア（修正標準的方式）	8,865	9,733

MR４：内部モデル方式のバック・テスティングの結果
直近250営業日分において、グループ・レベルでのバック・テスティング超過は1度発生しました。



(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（ΔEVE）

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ΔEVEは、2021年９月期末において弊社グループのTier１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（ΔNII）

野村の資産負債構成におけるΔNII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ΔNII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) マクロプルーデン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%	46,710		
ルクセンブルク	0.50%	158,532		
小計		205,243		
合計		5,525,189	0.02%	1,807,404

(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Tier１　資本に係る基礎項目の額
5	2022年３月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier１　資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(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	-
34a	劣後性の手段 (23)	-
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	-

２．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 （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
34a	劣後性の手段 (23)	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	劣後債務
36	非充足資本等要件の有無　(25)	無
37	非充足資本等要件の内容　(25)	-

３．野村ホールディングス株式会社　第３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	JP376260AM68
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３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	225,000百万円
9	額面総額(5)	225,000百万円
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)	2021年6月15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：2026年7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)	令和8年7月15日及びその5年後毎の応当日に到来する各利率改定日（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)	令和8年7月15日から5年後毎の応当日に到来する各利率改定日
	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)	2021年6月16日から2026年7月15日まで: 年1.30パーセント 2026年7月15日の翌日以降: 5年国債金利 + 1.388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
34a	劣後性の手段 (23)	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	-

４．野村ホールディングス株式会社　第２回無担保社債（劣後特約付）

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	Tier２　資本に係る基礎項目の額
5	2022年３月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	無
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(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	3,950百万円
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	-
34a	劣後性の手段 (23)	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	有
37	非充足資本等要件の内容 (25)	実質破綻認定時損失吸収条項

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
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 Tier２　資本に係る基礎項目の額
5	2022年３月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier１　資本に係る基礎項目の額 Tier２　資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(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	2,005百万円
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	-
34a	劣後性の手段 (23)	-
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無　(25)	無
37	非充足資本等要件の内容　(25)	-

第５章　自己資本調達手段に関する契約内容（その他外部 TLAC 調達手段の概要）

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社第1回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	野村ホールディングス株式会社第2回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2025年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:JP376260AJ97	ISIN:JP376260AK94	ISIN:US65535HAP47
3	準拠法	日本法	日本法	米国ニューヨーク州法
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)	無	無	契約
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	JPY 100,000	JPY 40,000	USD 1,500
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2018年9月4日	2019年9月3日	2020年1月16日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2023年9月4日	2024年9月3日	2025年1月16日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	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	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	0.3%	0.29%	2.648%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2030年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2025年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2030年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:US65535HAQ20	ISIN:US65535HAR03	ISIN:US65535HAS85
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法
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)	契約	契約	契約
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 1,500	USD 1,500	USD 1,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2020年1月16日	2020年7月13日	2020年7月13日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2030年1月16日	2025年7月16日	2030年7月16日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	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	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	3.103%	1.851%	2.679%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2026年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2028年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2031年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:US65535HAW97	ISIN: US65535HAY53	ISIN: US65535HAX70
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法
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)	契約	契約	契約
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 1,250	USD 1,000	USD 1,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2021年7月12日	2021年7月12日	2021年7月12日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2026年7月14日	2028年7月14日	2031年7月14日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	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	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	1.653%	2.172%	2.608%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社第3回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:JP376260AM92	－	－
3	準拠法	日本法	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	JPY 120,000	USD 210	USD 45
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2021年9月6日	2018年8月2日	2018年9月26日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2026年9月4日	2025年8月4日	2025年9月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	－	2019年11月4日、全額	2019年12月26日、全額
	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	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	0.28%	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 20	USD 50	USD 50
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2018年9月28日	2018年9月28日	2018年10月23日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2023年9月28日	2025年9月30日	2023年10月23日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2019年12月30日、全額	2019年12月30日、全額	2020年1月23日、全額
	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)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	JPY 2,000	USD 180	USD 30
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2018年10月31日	2018年11月30日	2018年11月30日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2023年10月31日	2023年11月30日	2025年11月28日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年1月31日、全額	2020年2月28日、全額	2020年2月28日、全額
	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)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　(単位：百万通貨単位)	USD 50	JPY 5,000	USD 45
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2018年12月21日	2019年1月7日	2019年1月11日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2025年12月22日	2029年1月9日	2024年1月11日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年3月23日、全額	2020年4月7日、全額	2020年4月13日、全額
	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)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 18	USD 45	USD 20
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年1月11日	2019年1月18日	2019年1月28日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2026年1月13日	2024年1月18日	2026年1月28日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年4月13日、全額	2020年4月20日、全額	2020年4月28、全額
	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)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　(単位：百万通貨単位)	USD 40	JPY 5,000	USD 28
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年1月31日	2019年2月12日	2019年2月22日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2024年1月31日	2029年2月12日	2026年2月23日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年4月30日、全額	2020年5月12日、全額	2020年5月22日、全額
	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)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 40	USD 55	JPY 5,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年2月28日	2019年3月15日	2019年3月27日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2024年2月28日	2024年3月15日	2029年3月27日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年5月28日、全額	2020年6月15日、全額	2020年6月29日、全額
	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)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 82	USD 100	USD 46
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年3月29日	2019年3月29日	2019年6月28日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2026年3月31日	2029年3月29日	2024年6月28日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年6月30日、全額	2020年6月29日、全額	2020年9月28日、全額
	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)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 30	USD 30	USD 46
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年7月12日	2019年11月15日	2020年3月27日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2026年7月15日	2026年11月16日	2025年3月27日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年7月15日、全額	2021年2月15日、全額	2021年6月27日、全額
	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	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－	－	－
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
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	日本法	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)	無	無	無
	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	－	－	－
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	－	－	－
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	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
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	－	－	－
9	額面総額(5)　（単位：百万通貨単位）	USD 30	USD 47	USD 50
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2020年9月24日	2020年9月28日	2021年3月26日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2027年9月24日	2025年9月29日	2028年3月27日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2022年3月24日、全額	2021年12月28日、全額	2022年6月26日、全額
	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	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	－	－	－
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	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)	無	無	無
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	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	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	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	無	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	－	－	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－	－	－

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		－
1	発行者	野村ホールディングス
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
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)	無
	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	－
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	－
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	TLAC適格シニアローン
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	－
9	額面総額(5)　(単位：百万通貨単位)	USD 83
10	表示される科目の区分(6)	
	連結貸借対照表	負債
11	発行日(7)	2021年5月27日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2028年5月31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)	2022年8月31日、全額
	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)	変動
18	配当率又は利率(12)	－
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)	無
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	－
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC　調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	－

（注）配当率又は利率を一般に公表していない円建て資本調達手段について、基準日時点の加重平均金利は、0.366%(小数点第4位四捨五入）です。
配当率又は利率を一般に公表していないドル建て資本調達手段について、基準日時点の加重平均金利は、1.375%(小数点第4位四捨五入）です。

第６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	2021年９月末	2021年６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	23,646,912	22,610,303	22,936,246
１ａ	1	連結貸借対照表における総資産の額	41,144,819	40,222,049	40,032,489
１ｂ	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額（△）（注１）	230,056	226,828	123,476
１ｃ	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子法人の資産の額（連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。）	－	－	－
１ｄ	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額（△）	17,267,850	17,384,917	16,972,766
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額（△）	125,961	130,277	169,979
3		オン・バランス資産の額　（イ）	23,520,951	22,480,026	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	1,925,844	1,788,668	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	4,564,717	4,490,105	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	1,157,604	1,251,778	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（△）	1,195,226	1,148,216	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	18,046,879	17,452,527	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（△）	17,035,959	16,462,805	15,666,699
11	4	デリバティブ取引等に関する額　（ロ）	7,463,859	7,372,058	7,141,813

（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	2021年９月末	2021年６月末	2020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	36,349,602	35,970,873	31,624,973
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額（△）	20,418,176	19,923,138	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	1,539,739	1,356,638	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）	17,471,165	17,404,373	16,721,166
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	3,184,239	3,506,361	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（△）	1,198,348	1,311,603	1,021,062
19	6	オフ・バランス取引に関する額　（ニ）	1,985,890	2,194,757	2,101,835
連結レバレッジ比率(5)					
20		資本の額　（ホ）	2,979,328	2,986,781	2,855,329
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）＋（ロ）＋（ハ）＋（ニ））　（へ）	50,441,867	49,451,215	48,731,083
22		連結レバレッジ比率（（ホ）／（へ））	5.90%	6.03%	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　（へ）	50,441,867	49,451,215	48,731,083
		日本銀行に対する預け金の額	2,201,732	1,608,154	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　（へ´）	52,643,600	51,059,370	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）／（へ´））	5.65%	5.84%	5.55%

（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。

第７章　TLAC規制

（単位：百万円、％）

TLAC１：TLACの構成			
国際様式の該当番号	項目		イ
			2021年９月末
想定される処理方針について(1)			
当グループについて想定されている望ましい処理方針はSPE（Single Point of Entry）アプローチです。具体的には、主要子会社である野村證券、野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービシズ又はNomura Europe Holdings PLCに財務上の危機が生じた場合、関連当局のイニシアチブの下、持株会社である野村ホールディングスが損失の集約先となり法的破産手続の下で処理される一方、健全性を回復した主要子会社は預金保険機構が出資する承継持株会社の傘下に移転した上で通常通り営業を続けることが想定されます。			
自己資本比率規制上の外部TLAC(2)			
1	普通株式等Tier１　資本の額	（イ）	2,602,705
2	TLAC調整項目適用前のその他Tier１　資本の額	（ロ）	376,622
3	子会社発行のTLAC非適格その他Tier１　資本の額	（ハ）	－
4	その他のその他Tier１　資本に係る調整項目	（ニ）	－
5	外部TLAC適格のその他Tier１　資本の額（（ロ）－（ハ）－（ニ））	（ホ）	376,622
6	TLAC調整項目適用前のTier２　資本の額	（ヘ）	4,331
7	残存期間が１年以上５年以下のTier２　資本のうち、自己資本比率の算定上控除されている額	（ト）	－
8	子会社発行のTLAC非適格Tier２　資本の額	（チ）	－
9	その他のTier２　資本に係る調整項目	（リ）	3,950
10	外部TLAC適格のTier２　資本の額（（ヘ）－（ト）－（チ）－（リ））	（ヌ）	381
11	自己資本比率規制上の外部TLACの額（（イ）＋（ホ）＋（ヌ））	（ル）	2,979,710
自己資本比率規制外の外部TLAC(3)			
12	その他外部TLACの額	（ヲ）	1,420,153
13	特例外部TLAC調達手段（＝劣後性要件を除く全ての外部TLAC適格要件を満たすもの）の総額		
14	特例外部TLAC調達手段のうち、外部TLACへの算入が認められている額		
15	TLAC完全適用以前に資金調達ビークルによって発行された外部TLAC		
16	資本再構築のための事前のコミットメント相当額	（ワ）	367,579
17	調整項目適用前の自己資本比率規制外の外部TLACの額（（ヲ）＋（ワ））	（カ）	1,787,733
自己資本比率規制外の外部TLAC（調整項目）(4)			
18	外部TLACの額（調整前）（（ル）＋（カ））	（ヨ）	4,767,443
19	破綻処理グループ間のエクスポージャー	（タ）	－
20	自己保有のその他TLAC負債の額	（レ）	501
21	その他調整項目	（ソ）	－
22	外部TLACの額（調整後）（（ヨ）－（タ）－（レ）－（ソ）	（ツ）	4,766,941

（単位：百万円、%）

国際様式の該当番号	項目	イ
		2021年９月末
リスク・アセットの額及び総エクスポージャー(5)		
23	リスク・アセットの額　（ネ）	14,703,195
24	総エクスポージャーの額　（ナ）	50,441,867
外部TLAC比率及び資本バッファー(6)		
25	資本バッファー勘案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率（（ツ）／（ネ））	32.42%
25a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	29.40%
26	総エクスポージャーベース外部TLAC比率（（ツ）／（ナ））	9.45%
27	連結資本バッファー比率	12.29%
28	最低連結資本バッファー比率	3.02%
29	うち、資本保全バッファー比率	2.50%
30	うち、カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.02%
31	うち、G-SIB/D-SIBバッファー比率	0.50%
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ベース外部TLAC比率(7)		
	総エクスポージャーの額　（ナ）	50,441,867
	日本銀行に対する預け金の額	2,201,732
	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　（ナ’）	52,643,600
	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ベース外部TLAC比率（（ツ）／（ナ’））	9.05%

（単位：百万円）

TLAC２：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）									
野村證券（単体）									
			債務者順位						合計
国際様式の該当番号	項目		1		2		3		
			最劣後				最優先		
1	破綻処理対象法人が債権者か否か		✓	―	✓	―	✓	―	
2	債権者順位に関する説明		普通株式		長期劣後債務・短期劣後債務		その他内部TLAC調達手段		
3	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法勘案後）（イ）		548,106	－	470,000	－	－	－	1,018,106
4	うち除外債務（ロ）		－	－	－	－	－	－	－
5	資本及び負債の合計（除外債務控除後）（（イ）－（ロ））		548,106	－	470,000	－	－	－	1,018,106
6	うち内部TLAC適格のもの		548,106	－	470,000	－	－	－	1,018,106
7	残存期間	１年以上２年未満	－	－	－	－	－	－	－
8		２年以上５年未満	－	－	170,000	－	－	－	170,000
9		５年以上10年未満	－	－	300,000	－	－	－	300,000
10		10年以上（永久債を除く）	－	－	－	－	－	－	－
11		満期がないもの（永久債を含む）	548,106	－	－	－	－	－	548,106

（単位：百万円）

TLAC２：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）									
野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービシズ（単体）									
			債務者順位						合計
国際様式の該当番号	項目		1		2		3		
			最劣後				最優先		
1	破綻処理対象法人が債権者か否か		✓	－	✓	－	✓	－	
2	債権者順位に関する説明		普通株式		長期劣後債務・短期劣後債務		その他内部TLAC調達手段		
3	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法勘案後）（イ）		353,500	－	249,467	－	－	－	602,967
4	うち除外債務（ロ）		－	－	－	－	－	－	－
5	資本及び負債の合計（除外債務控除後）（（イ）－（ロ））		353,500	－	249,467	－	－	－	602,967
6	うち内部TLAC適格のもの		353,500	－	249,467	－	－	－	602,967
7	残存期間	１年以上２年未満	－	－	－	－	－	－	－
8		２年以上５年未満	－	－	190,741	－	－	－	190,741
9		５年以上10年未満	－	－	58,726	－	－	－	58,726
10		10年以上（永久債を除く）	－	－	－	－	－	－	－
11		満期がないもの（永久債を含む）	353,500	－	－	－	－	－	353,500

（単位：百万円）

TLAC２：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）									
Nomura Europe Holdings PLC（サブ連結）									
			債務者順位						合計
国際様式の該当番号	項目		1		2		3		
			最劣後				最優先		
1	破綻処理対象法人が債権者か否か		✓	－	✓	－	✓	－	
2	債権者順位に関する説明		普通株式		Tier2資本調達手段		その他内部TLAC調達手段		
3	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法勘案後）（イ）		380,157	－	241,617	－	－	－	621,774
4	うち除外債務（ロ）		－	－	－	－	－	－	－
5	資本及び負債の合計（除外債務控除後）（（イ）－（ロ））		380,157	－	241,617	－	－	－	621,774
6	うち内部TLAC適格のもの		380,157	－	241,617	－	－	－	621,774
7	残存期間	１年以上２年未満	－	－	－	－	－	－	－
8		２年以上５年未満	－	－	－	－	－	－	－
9		５年以上10年未満	－	－	241,617	－	－	－	241,617
10		10年以上（永久債を除く）	－	－	－	－	－	－	－
11		満期がないもの（永久債を含む）	380,157	－	－	－	－	－	380,157

（単位：百万円）

TLAC２：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）											
Nomura International PLC（単体）											
			債務者順位								合計
国際様式の該当番号	項目		1		2		3		4		
			最劣後						最優先		
1	破綻処理対象法人が債権者か否か		✓	―	✓	―	✓	―	✓	―	
2	債権者順位に関する説明		普通株式		Tier2資本調達手段		長期劣後債務・短期劣後債務		その他内部TLAC調達手段		
3	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法勘案後）（イ）		365,637	－	140,943	－	117,453	－	－	－	624,033
4	うち除外債務（ロ）		－	－	－	－	－	－	－	－	－
5	資本及び負債の合計（除外債務控除後）（（イ）－（ロ））		365,637	－	140,943	－	117,453	－	－	－	624,033
6	うち内部TLAC適格のもの		365,637	－	140,943	－	117,453	－	－	－	624,033
7	残存期間	１年以上２年未満	－	－	－	－	117,453	－	－	－	117,453
8		２年以上５年未満	－	－	－	－	－	－	－	－	－
9		５年以上10年未満	－	－	140,943	－	－	－	－	－	140,943
10		10年以上（永久債を除く）	－	－	－	－	－	－	－	－	－
11		満期がないもの（永久債を含む）	365,637	－	－	－	－	－	－	－	365,637

（注）

Nomura Europe Holdings PLCおよびNomura International PLCは、イングランド銀行が適用するMREL規制（Minimum Requirement for Own Funds and Eligible Liabilities）のもと内部MRELを維持することが求められており、その額は「Tier２資本調達手段」及び「長期劣後債務・短期劣後債務」に含まれています。

（単位：百万円）

TLAC３：外部TLAC等の債権者順位							
野村ホールディングス（単体）			債務者順位				合計
国際様式の該当番号	項目		1 最劣後	2	3	4 最優先	
1	債権者の優先順位に関する説明		普通株式	その他Tier１資本調達手段	Tier２資本調達手段	無担保シニア債	
2	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法勘案後）（イ）		1,154,169	375,000	3,950	3,066,684	4,599,803
3	うち除外債務（ロ）		－	－	－	16,909	16,909
4	資本及び負債の合計（除外債務控除後）（（イ）－（ロ））		1,154,169	375,000	3,950	3,049,774	4,582,893
5	うち外部TLAC適格のもの		1,154,169	375,000	－	1,420,153	2,949,322
6	残存期間	１年以上２年未満	－	－	－	102,237	102,237
7		２年以上５年未満	－	－	－	766,726	766,726
8		５年以上10年未満	－	－	－	551,189	551,189
9		10年以上（永久債を除く）	－	－	－	－	－
10		満期がないもの（永久債を含む）	1,154,169	375,000	－	－	1,529,169

（注）

1　Tier2資本調達手段には、適格旧Tier2資本調達手段を含みます。

2　無担保シニア債については、グループ内取引を控除しています。

3　除外債務については、金額的な重要性を考慮の上、保守的に計上しています。

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 （2022年3月期 第2 四半期）		前最終指定親会社四半期 （2022年3月期 第1 四半期）	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	6,024,539		5,451,717	
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	511,452	64,007	517,086	62,262
3	うち、安定預金の額	－	－	－	－
4	うち、準安定預金の額	511,452	64,007	517,086	62,262
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,995,341	1,750,230	2,068,761	1,833,149
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	1,417,173	1,172,062	1,414,176	1,178,564
8	うち、負債性有価証券の額	578,168	578,168	654,585	654,585
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,674,897		2,848,077
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	2,258,818	1,839,586	2,412,126	1,985,097
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,681,764	1,681,764	1,837,867	1,837,867
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	577,054	157,822	574,259	147,230
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,576,445	813,227	3,718,499	896,127
15	偶発事象に係る資金流出額	473,101	222,979	440,559	194,885
16	資金流出合計額		7,364,926		7,819,597
資金流入額 (3)		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	31,346,646	2,287,640	31,263,370	2,233,437
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	1,316,815	1,222,988	1,348,927	1,261,790
19	その他資金流入額	3,868,036	1,637,488	4,265,921	1,786,106
20	資金流入合計額	36,531,497	5,148,116	36,878,218	5,281,334
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		6,024,539		5,451,717
22	純資金流出額		2,219,276		2,538,263
23	連結流動性カバレッジ比率		272.8%		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5,728億22百万円増の6兆245億39百万円となりました。有担保資金調達等に係る資金流出額が同1,731億80百万円減の2兆6748億97百万円、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1,455億11百万円減の1兆8,395億86百万円、その他資金流入額が同1,486億19百万円減の1兆6,374億88百万円、純資金流出額は同3,189億88百万円減の2兆2,192億76百万円となりました。

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272.8％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出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章　連結安定調達比率に関する定量的開示事項

（単位：百万円、％）

項番		当最終指定親会社四半期末（2021年９月末）					前最終指定親会社四半期末（2021年６月末）				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	６月未満	６月以上１年未満	１年以上		満期なし	６月未満	６月以上１年未満	１年以上	
利用可能安定調達額(1)											
1	資本の額	3,108,087	－	－	－	3,108,087					
2	うち、普通株式等 Tier1資本、その他 Tier1資本及び Tier2資本（基準日から１年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。）に係る基礎項目の額	3,108,087	－	－	－	3,108,087					
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	－	－	－	－	－					
4	個人及び中小企業等からの資金調達	212,187	192,833	106,671	14,823	475,345					
5	うち、安定預金等の額	－	－	－	－	－					
6	うち、準安定預金等の額	212,187	192,833	106,671	14,823	475,345					
7	ホールセール資金調達	2,579,657	14,925,494	1,108,617	7,852,824	9,161,748					
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	－	－	－	－	－					
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	2,579,657	14,925,494	1,108,617	7,852,824	9,161,748					
10	相互に関係する資産がある負債	－	－	－	－	－					
11	その他の負債	8,429,892	2,658,836	71,233	241,550	344,713					
12	うち、デリバティブ負債の額				－						
13	うち、上記に含まれない負債の額	8,429,892	2,658,836	71,233	241,550	344,713					
14	利用可能安定調達額合計					13,089,893					
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額					1,383,642					
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	140,821	6,883	－	－	73,852					
17	貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	2,296,520	17,003,746	1,473,986	3,594,325	6,853,771					
18	うち、レベル１資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	109	9,655,633	32,913	59,909	129,673					
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	739,773	5,594,851	893,007	1,378,440	2,876,794					
20	うち、貸出金又はレポ形式の取引による資産の額（項番18、19及び22に該当する額を除く。）	15,462	1,530,896	84,724	532,892	734,679					
21	うち、リスク・ウェイトが35％以下の資産の額	－	1,055	3,346	27,378	17,795					
22	うち、住宅ローン債権	－	－	－	－	－					
23	うち、リスク・ウェイトが35％以下の資産の額	－	－	－	－	－					
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	1,541,176	222,366	463,342	1,623,084	3,112,625					
25	相互に関係する負債がある資産	－	－	－	－	－					

項番		当最終指定親会社四半期末 (2021年９月末)					前最終指定親会社四半期末 (2021年６月末)				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	６月未満	６月以上 １年未満	１年以上		満期なし	６月未満	６月以上 １年未満	１年以上	
26	その他の資産等	518,456	252,110	－	2,339,381	2,650,262					
27	うち、現物決済されるコモディティ（金を含む。）	－				－					
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金（連結貸借対照表に計上されないものを含む。）				1,383,834	1,176,258					
29	うち、デリバティブ資産の額				105,226	105,226					
30	うち、デリバティブ負債（変動証拠金の対価の額を減ずる前）の額				120,231	120,231					
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	518,456	252,110	－	730,091	1,248,548					
32	オフ・バランス取引				1,192,006	188,254					
33	所要安定調達額合計					11,149,781					
34	連結安定調達比率					117.4%					

第４章　連結安定調達比率に関する定性的開示事項

１．時系列における連結安定調達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末の利用可能安定調達額は 13 兆 898 億 93 百万円、所要安定調達額は 11 兆 1,497 億 81 百万円となりました。

この結果、会社グループの第 2 四半期連結会計期末における連結安定調達比率は、117.4％となりました。

会社グループの連結安定調達比率が変動する主な要因としては、無担保・有担保資金調達、顧客との有価証券売買取引に伴うトレーディング在庫、無担保貸出・有担保資金運用及びデリバティブ取引等におけるバランスシートの変化が挙げられます。

２．連結流動性比率告示第 99 条に定める「相互に関係する資産・負債の特例」の適用

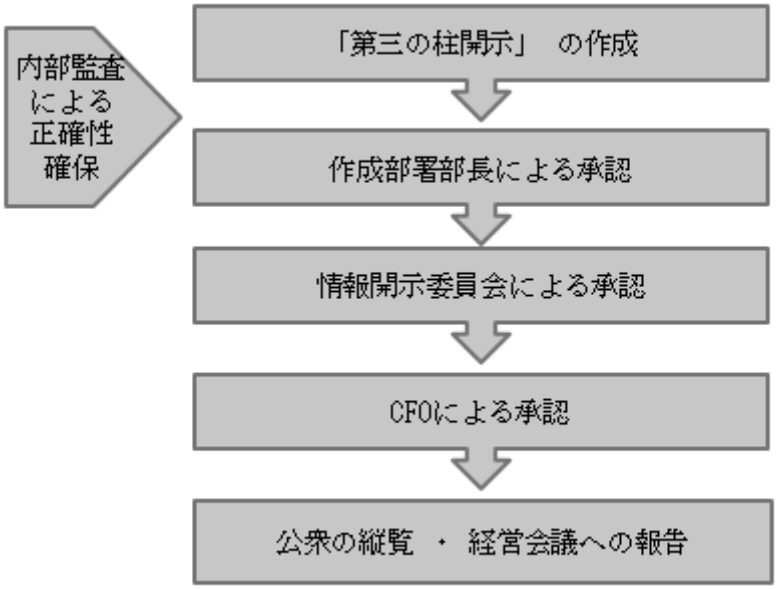
会社グループの連結安定調達比率において適用対象となるものはございません。

３．その他連結安定調達比率に関する事項

会社グループの第２四半期末の連結安定調達比率は法令上の最低要求水準を上回っており、会社グループの営業活動に伴って保有しているトレーディング在庫等の資産に対して、適切な安定調達を維持しております。

また、会社グループでは連結安定調達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を維持するよう運営を行っております。

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CFOによる承認後、公衆の縦覧に供するとともに、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。