

# 業務及び財産の状況に関する説明書

## 【2018年3月期】

この説明書は、金融商品取引法第46条の4に定める金融商品取引業等に関する内閣府令第174条の2の規定に基づき、投資者が常に容易に閲覧することができるよう公表するために作成したものです。

# 野村證券

# 目 次

頁

|                                                                         |    |
|-------------------------------------------------------------------------|----|
| I. 当社の概況及び組織に関する事項                                                      | 1  |
| 1. 商号                                                                   | 1  |
| 2. 登録年月日（登録番号）                                                          | 1  |
| 3. 沿革及び経営の組織                                                            | 1  |
| 4. 株式の保有数の上位10位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に<br>占める当該株式に係る議決権の数の割合 | 4  |
| 5. 役員の氏名又は名称                                                            | 4  |
| 6. 政令で定める使用人の氏名                                                         | 5  |
| 7. 業務の種別                                                                | 6  |
| 8. 本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地                                               | 7  |
| 9. 加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の名称                                  | 12 |
| 10. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号                                          | 12 |
| 11. 加入する投資者保護基金の名称                                                      | 12 |
| 12. 苦情処理及び紛争解決の体制                                                       | 12 |
| II. 業務の状況に関する事項                                                         | 13 |
| 1. 当期の業務の概要                                                             | 13 |
| 2. 業務の状況を示す指標                                                           | 15 |
| III. 財産の状況に関する事項                                                        | 21 |
| 1. 経理の状況                                                                | 21 |
| 2. 借入金の主要な借入先及び借入金額                                                     | 51 |
| 3. 保有する有価証券（トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く）の取得価額、<br>時価及び評価損益           | 51 |
| 4. デリバティブ取引（トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く）の契約価額、<br>時価及び評価損益             | 52 |
| 5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無                                               | 52 |
| IV. 管理の状況                                                               | 53 |
| 1. 内部管理の状況の概要                                                           | 53 |
| 2. 分別管理等の状況                                                             | 54 |
| V. 連結子会社等の状況に関する事項                                                      | 57 |
| 1. 企業集団の構成                                                              | 57 |
| 2. 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等                              | 57 |

## I．当社の概況及び組織に関する事項

### 1．商号

野村證券株式会社

### 2．登録年月日（登録番号）

2007年9月30日（関東財務局長（金商）第142号）

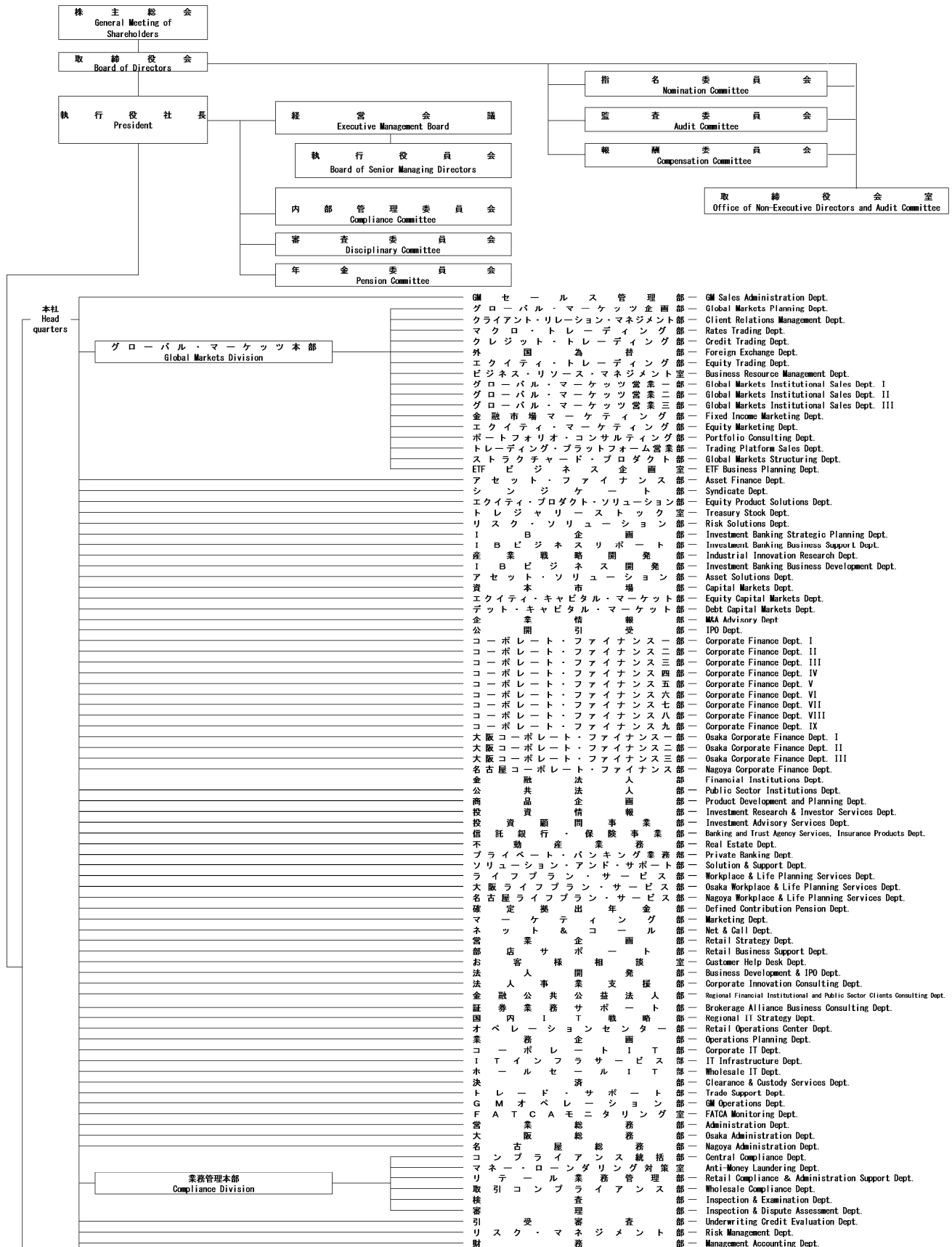
### 3．沿革及び経営の組織

#### (1) 会社の沿革

| 年月       | 沿革                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2001年5月  | 東京都中央区において、野村證券株式会社（現会社名 野村ホールディングス株式会社）の持株会社体制への移行に伴う証券業務の承継会社となる目的で、同社の完全子会社として設立（会社名 野村證券分割準備株式会社）。<br>野村證券株式会社（現会社名 野村ホールディングス株式会社）の営む営業を承継すると共に、社名を野村證券株式会社へ変更。<br>野村企業情報株式会社を吸収合併。<br>指名委員会等設置会社へ移行。<br>リーマン・ブラザーズ証券株式会社等の雇用契約の承継。<br>ジョインベスト証券株式会社を吸収合併。<br>野村年金サポート&サービス株式会社を吸収合併。 |
| 2001年10月 |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2002年4月  |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2003年6月  |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2008年10月 |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2009年11月 |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2011年10月 |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

(2) 経営の組織

2018年7月現在の経営組織図は以下のとおりであります。



(次ページに続く)



4. 株式の保有数の上位10位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合

(2018年3月31日現在)

| 氏名又は名称         | 保有株式数     | 割合          |
|----------------|-----------|-------------|
| 野村ホールディングス株式会社 | 千株<br>201 | %<br>100.00 |

5. 役員の氏名又は名称

(2018年7月現在)

取締役

| 役職名   | 氏名     | 常勤・非常勤の別 |
|-------|--------|----------|
| 取締役   | 古賀 信行  | 常勤       |
| 取締役会長 | 永井 浩二  | 常勤       |
| 取締役   | 尾崎 哲一  | 常勤       |
| 〃     | 永松 昌一  | 常勤       |
| 〃     | 森田 敏夫  | 常勤       |
| 〃     | 奥田 健太郎 | 常勤       |
| 〃     | 松谷 博司  | 常勤       |
| 〃     | 南村 芳寛  | 常勤       |
| 〃     | 柳井 健寿  | 常勤       |
| 〃     | 島崎 憲明  | 非常勤      |
| 〃     | 樋渡 利秋  | 非常勤      |
| 〃     | 尾崎 元規  | 非常勤      |

注(1) 取締役のうち、樋渡利秋及び尾崎元規は、会社法第2条第15号に定める社外取締役であります。

(2) 当社は指名委員会等設置会社であります。委員会体制につきましては次のとおりであります。

|       |     |       |
|-------|-----|-------|
| 指名委員会 | 委員長 | 古賀 信行 |
|       | 委員  | 樋渡 利秋 |
|       | 委員  | 尾崎 元規 |
| 報酬委員会 | 委員長 | 古賀 信行 |
|       | 委員  | 樋渡 利秋 |
|       | 委員  | 尾崎 元規 |
| 監査委員会 | 委員長 | 島崎 憲明 |
|       | 委員  | 樋渡 利秋 |
|       | 委員  | 尾崎 元規 |

執行役

| 役職名             | 氏名     | 代表権の有無 | 常勤・非常勤の別 |
|-----------------|--------|--------|----------|
| 代表執行役<br>執行役社長  | 森田 敏夫  | 有      | 常勤       |
| 代表執行役<br>執行役副社長 | 山口 英一郎 | 有      | 常勤       |
| 代表執行役<br>執行役副社長 | 中田 裕二  | 有      | 常勤       |
| 執行役副社長          | 奥田 健太郎 | 無      | 常勤       |
| 執行役             | 中島 豊   | 無      | 常勤       |
| 執行役             | 飯山 俊康  | 無      | 常勤       |
| 執行役             | 新井 聡   | 無      | 常勤       |
| 代表執行役           | 寺口 智之  | 有      | 常勤       |
| 執行役             | 北村 巧   | 無      | 常勤       |

6. 政令で定める使用人の氏名

(1) 金融商品取引業に関し、法令等を遵守させるための指導に関する業務を統括する使用人の氏名

| 氏名      | 役職名            |
|---------|----------------|
| 矢 野 公 司 | 執行役員           |
| 池 田 隆 行 | コンプライアンス統括部長   |
| 萩 原 宏 治 | 取引コンプライアンス部長   |
| 篠 原 烈   | リテール業務管理部長     |
| 畑 靖 史   | 検査部長           |
| 松 野 秀 人 | 審理部長           |
| 田 端 敏 行 | マネー・ロンダリング対策室長 |

(2) 投資助言業務又は投資運用業に関し、助言又は運用を行う部門を統括する使用人の氏名

| 氏名      | 役職名                               |
|---------|-----------------------------------|
| 萩 島 誠 治 | フィデューシャリー・マネジメント部長                |
| 能 見 哲 理 | 投資顧問事業部長                          |
| 百 瀬 善 健 | アセット・ファイナンス部長                     |
| 生 越 久 夫 | 投資顧問事業部 課長                        |
| 梶 樹 弘   | 投資顧問事業部 次長                        |
| 南 田 弘 一 | フィデューシャリー・マネジメント部 エグゼクティブ・コンサルタント |
| 松 村 基 見 | 投資顧問事業部 課長                        |
| 春 日 俊 介 | フィデューシャリー・マネジメント部 エグゼクティブ・ディレクター  |
| 清 水 信 行 | フィデューシャリー・マネジメント部 エグゼクティブ・ディレクター  |
| 笠 原 孝 高 | 投資顧問事業部 課長代理                      |
| 津 留 智 浩 | 投資顧問事業部 課長                        |
| 大 塚 研 吾 | フィデューシャリー・マネジメント部 ヴァイス・プレジデント     |
| 北 田 栄 一 | 不動産業務部長                           |

(3) 投資助言・代理業に関し、法第29条の2第1項第6号の営業所又は事務所の業務を統括する使用人の氏名

| 氏名      | 役職名                |
|---------|--------------------|
| 萩 島 誠 治 | フィデューシャリー・マネジメント部長 |
| 山 本 泰 正 | ソリューション・アンド・サポート部長 |

## 7. 業務の種別

### (1) 金融商品取引業（金融商品取引法第2条第8項）

- ① 金融商品取引法第28条第1項第1号に掲げる行為に係る業務
- ② 金融商品取引法第28条第1項第2号に掲げる行為に係る業務
- ③ 金融商品取引法第28条第1項第3号イに掲げる行為に係る業務
- ④ 金融商品取引法第28条第1項第3号ロに掲げる行為に係る業務
- ⑤ 金融商品取引法第28条第1項第3号ハに掲げる行為に係る業務
- ⑥ 有価証券等管理業務
- ⑦ 第二種金融商品取引業
- ⑧ 投資助言・代理業
- ⑨ 投資運用業

### (2) 金融商品取引業付随業務（金融商品取引法第35条第1項）

当社は、以下の業務その他金融商品取引業に付随する業務を行っています。

- ① 有価証券の貸借またはその媒介もしくは代理業務
- ② 信用取引に付随する金銭の貸付け業務
- ③ 保護預り有価証券を担保とする金銭の貸付け業務
- ④ 有価証券に関する顧客の代理業務
- ⑤ 投資信託に係る収益金、償還金または解約金の支払いに係る業務の代理
- ⑥ 投資証券等に係る分配金、払戻金もしくは残余財産の分配または利息もしくは償還金の支払に係る業務の代理
- ⑦ 累積投資契約の締結業務
- ⑧ 有価証券に関連する情報の提供または助言業務
- ⑨ 他の金融商品取引業者等の業務の代理
- ⑩ 他の事業者の事業の譲渡、合併、会社の分割、株式交換もしくは株式移転に関する相談に応じ、またはこれらに関する仲介を行う業務
- ⑪ 他の事業者の経営に関する相談に応じる業務
- ⑫ 通貨の売買またはその媒介、取次ぎもしくは代理業務
- ⑬ 譲渡性預金その他金銭債権の売買またはその媒介、取次ぎもしくは代理業務

### (3) その他（金融商品取引法第35条第2項および第4項）

金融商品取引法第35条第2項に掲げられた業務のうち、当社が行っている業務は以下のとおりです。

- ① 商品デリバティブ取引に係る業務
- ② 貸金業その他金銭の貸付けまたは金銭の貸借の媒介に係る業務
- ③ 貸出参加契約の締結またはその媒介、取次ぎもしくは代理に係る業務
- ④ 保険募集業務
- ⑤ 他の事業者の業務に関する電子計算機のプログラムの作成または販売を行う業務および計算受託業務
- ⑥ 国民年金基金連合会から委託を受けて行う事務に係る業務
- ⑦ 信託契約代理業務
- ⑧ 信託兼営金融機関のための遺言執行または遺産整理に係る契約の締結の媒介に係る業務
- ⑨ 銀行代理業務
- ⑩ 顧客に対し、他の事業者のあっせんまたは紹介を行う業務
- ⑪ 不動産の売買、交換および賃貸借の代理または仲介に係る業務
- ⑫ 外国商品先物取引等の自己売買及び代理に係る業務
- ⑬ 確定拠出年金運営管理業
- ⑭ 前各号に掲げる業務に附帯する業務

金融商品取引法第35条第4項の規定に基づき、内閣総理大臣の承認を受けて行っている業務は以下のとおりです。

- ① リミテッド・ライアビリティ・カンパニーへの優先出資の売買ならびにその媒介、取次ぎおよび代理に係る業務

### (4) 金融商品取引業等に関する内閣府令第7条第4号から第9号までに掲げる事項

- ① 不動産信託受益権等売買等業務



8. 本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地

(2018年7月現在)

| 名称       | 所在地                     |
|----------|-------------------------|
| 本店       | 東京都中央区日本橋1-9-1          |
| 大阪支店     | 大阪府大阪市中央区平野町3丁目5番12号    |
| 名古屋支店    | 愛知県名古屋市中区錦2-19-22       |
| 札幌支店     | 北海道札幌市中央区北三条西4-1-1      |
| 旭川支店     | 北海道旭川市五条通9丁目右1号         |
| 釧路支店     | 北海道釧路市北大通12-1-4         |
| とちぎ帯広営業所 | 北海道帯広市西3条南10-32         |
| 函館支店     | 北海道函館市本町31-15           |
| 青森支店     | 青森県青森市新町2-6-29          |
| 八戸支店     | 青森県八戸市廿三日町28            |
| 盛岡支店     | 岩手県盛岡市大通2-2-18          |
| 秋田支店     | 秋田県秋田市中通4-2-7           |
| 仙台支店     | 宮城県仙台市青葉区中央2-1-1        |
| 山形支店     | 山形県山形市十日町1-7-30         |
| 福島支店     | 福島県福島市大町4-1             |
| 郡山支店     | 福島県郡山市駅前2-5-12          |
| いわき営業所   | 福島県いわき市平字田町120番地        |
| 新潟支店     | 新潟県新潟市中央区上大川前通六番町1215-7 |
| 長野支店     | 長野県長野市南長野末広町1361        |
| 松本支店     | 長野県松本市中央2-1-34          |
| 富山支店     | 富山県富山市堤町通り1-4-3         |
| 金沢支店     | 石川県金沢市上堤町3-21           |
| 福井支店     | 福井県福井市大手3-4-1           |
| 川崎支店     | 神奈川県川崎市川崎区東田町5-2        |
| 武蔵小杉支店   | 神奈川県川崎市中原区中丸子13-2       |
| 新百合ヶ丘支店  | 神奈川県川崎市麻生区上麻生1-2-7      |
| 横浜支店     | 神奈川県横浜市西区北幸1-5-10       |
| 横浜馬車道支店  | 神奈川県横浜市中区尾上町4-52        |
| 鶴見支店     | 神奈川県横浜市鶴見区鶴見中央1-4-1     |
| 戸塚支店     | 神奈川県横浜市戸塚区上倉田町489-1     |
| たまプラーザ支店 | 神奈川県横浜市青葉区美しが丘5-1-2     |
| 青葉台支店    | 神奈川県横浜市青葉区青葉台2-6-1      |
| 鎌倉支店     | 神奈川県鎌倉市御成町11-32         |

| 名称           | 所在地                  |
|--------------|----------------------|
| 横須賀支店        | 神奈川県横須賀市大滝町1-9       |
| 藤沢支店         | 神奈川県藤沢市鵠沼石上1-5-10    |
| 平塚支店         | 神奈川県平塚市紅谷町4-23       |
| 小田原支店        | 神奈川県小田原市栄町1-6-1      |
| 厚木支店         | 神奈川県厚木市中町2-2-20      |
| 相模原支店        | 神奈川県相模原市中央区相模原4-3-14 |
| 沼津支店         | 静岡県沼津市大手町3-4-21      |
| 静岡支店         | 静岡県静岡市葵区御幸町6-6       |
| 浜松支店         | 静岡県浜松市中区田町330-5      |
| 甲府支店         | 山梨県甲府市丸の内1-17-10     |
| 川口支店         | 埼玉県川口市栄町3-10-1       |
| 所沢支店         | 埼玉県所沢市日吉町10-21       |
| 川越支店         | 埼玉県川越市脇田町105         |
| 越谷支店         | 埼玉県越谷市弥生町16-1        |
| 浦和支店         | 埼玉県さいたま市浦和区高砂2-13-8  |
| さいたま支店       | 埼玉県さいたま市大宮区大門町3-71-2 |
| さいたま支店 大宮東口店 | 埼玉県さいたま市大宮区大門町1-24   |
| 熊谷支店         | 埼玉県熊谷市筑波3-202        |
| 高崎支店         | 群馬県高崎市八島町58-1        |
| 太田支店         | 群馬県太田市浜町3-1          |
| 宇都宮支店        | 栃木県宇都宮市馬場通り2-1-1     |
| つくば支店        | 茨城県つくば市研究学園5-19      |
| 水戸支店         | 茨城県水戸市南町3-4-14       |
| 船橋支店         | 千葉県船橋市本町2-1-33       |
| 市川支店         | 千葉県市川市市川1-6-19       |
| 千葉支店         | 千葉県千葉市中央区富士見1-14-13  |
| 松戸支店         | 千葉県松戸市松戸1281-29      |
| 柏支店          | 千葉県柏市柏1-4-26         |
| 東京支店         | 東京都千代田区丸の内1-8-2      |
| 新橋支店         | 東京都港区東新橋1-5-2        |
| 虎ノ門支店        | 東京都港区虎ノ門2-1-1        |
| 品川支店         | 東京都港区港南2-16-1        |
| 大森支店         | 東京都大田区山王2-5-10       |
| 蒲田支店         | 東京都大田区蒲田5-15-8       |

| 名称             | 所在地                |
|----------------|--------------------|
| 田園調布支店         | 東京都大田区田園調布2-62-3   |
| 五反田支店          | 東京都品川区西五反田1-5-1    |
| 渋谷支店           | 東京都渋谷区渋谷1-14-16    |
| 中目黒支店          | 東京都目黒区上目黒2-9-1     |
| 自由が丘支店         | 東京都目黒区自由が丘2-10-9   |
| 玉川支店           | 東京都世田谷区玉川3-7-18    |
| 成城支店           | 東京都世田谷区成城5-8-1     |
| 新宿支店           | 東京都新宿区新宿5-17-9     |
| 新宿駅西口支店        | 東京都新宿区西新宿1-6-1     |
| 京王新宿店          | 東京都新宿区西新宿1-1-4     |
| 京王新宿店分室        | 東京都新宿区西新宿1-6-1     |
| 新宿野村ビル支店       | 東京都新宿区西新宿1-26-2    |
| 荻窪支店           | 東京都杉並区上荻1-8-8      |
| 中野支店           | 東京都中野区中野5-65-3     |
| 練馬支店           | 東京都練馬区豊玉北5-17-10   |
| 池袋支店           | 東京都豊島区南池袋1-27-10   |
| 池袋メトロポリタンプラザ支店 | 東京都豊島区西池袋1-11-1    |
| 上野支店           | 東京都台東区上野2-1-8      |
| 千住支店           | 東京都足立区千住寿町2-18     |
| 小岩支店           | 東京都江戸川区南小岩7-22-6   |
| 町田支店           | 東京都町田市原町田6-3-9     |
| 吉祥寺支店          | 東京都武蔵野市吉祥寺本町2-2-16 |
| 田無支店           | 東京都西東京市田無町4-2-11   |
| 立川支店           | 東京都立川市曙町2-5-1      |
| 国分寺支店          | 東京都国分寺市本町2-12-2    |
| 調布支店           | 東京都調布市布田1-36-9     |
| 府中支店           | 東京都府中市府中町1-8-1     |
| 八王子支店          | 東京都八王子市旭町11-6      |
| 名古屋駅前支店        | 愛知県名古屋市中村区名駅4-7-1  |
| 金山支店           | 愛知県名古屋市中区金山1-12-14 |
| 刈谷支店           | 愛知県刈谷市桜町1-10-2     |
| 春日井支店          | 愛知県春日井市鳥居松町4-68    |
| 豊橋支店           | 愛知県豊橋市駅前大通1-38     |
| 岡崎支店           | 愛知県岡崎市康生通西2-11     |
| 豊田支店           | 愛知県豊田市西町1-200      |

| 名称         | 所在地                 |
|------------|---------------------|
| 岐阜支店       | 岐阜県岐阜市神田町7－15       |
| 四日市支店      | 三重県四日市市諏訪栄町1－15     |
| 津支店        | 三重県津市羽所町371         |
| 梅田支店       | 大阪府大阪市北区小松原町2－4     |
| 天王寺支店      | 大阪府大阪市阿倍野区阿倍野筋1－6－1 |
| 上本町支店      | 大阪府大阪市中央区上本町西5－3－5  |
| なんば支店      | 大阪府大阪市中央区難波4－1－15   |
| 茨木支店       | 大阪府茨木市別院町1－21       |
| 大東支店       | 大阪府大東市赤井2－1－12      |
| 豊中支店       | 大阪府豊中市本町1－2－33      |
| 千里支店       | 大阪府豊中市新千里東町1－1－5    |
| 高槻支店       | 大阪府高槻市紺屋町3－1－101    |
| 枚方支店       | 大阪府枚方市岡東町5－15       |
| 東大阪支店      | 大阪府東大阪市長堂2－2－18     |
| 堺支店        | 大阪府堺市堺区三国ヶ丘御幸通59    |
| 岸和田支店      | 大阪府岸和田市筋海町6－10      |
| 大津支店       | 滋賀県大津市長等3－1－27      |
| 京都支店       | 京都府京都市下京区四条通堺町角     |
| 奈良支店       | 奈良県奈良市林小路町45        |
| 学園前支店      | 奈良県奈良市学園北1－11－3     |
| 和歌山支店      | 和歌山県和歌山市十番丁9－2      |
| 塚口支店       | 兵庫県尼崎市塚口町1－10－20    |
| 川西支店       | 兵庫県川西市中央町7－18       |
| 西宮支店       | 兵庫県西宮市甲風園1－3－8      |
| 神戸支店       | 兵庫県神戸市中央区三宮町1－5－32  |
| 岡本支店       | 兵庫県神戸市東灘区岡本1－8－3    |
| 明石支店       | 兵庫県明石市本町2－1－26      |
| 宝塚支店       | 兵庫県宝塚市栄町2－1－2       |
| 姫路支店       | 兵庫県姫路市白銀町18         |
| 岡山支店       | 岡山県岡山市北区錦町6－24      |
| 倉敷支店       | 岡山県倉敷市阿知3－9－10      |
| 米子支店       | 鳥取県米子市角盤町1－27－13    |
| 米子支店 鳥取営業所 | 鳥取県鳥取市東品治町102       |
| 松江支店       | 鳥取県松江市朝日町484－16     |
| 広島支店       | 広島県広島市中区立町2－23      |

| 名称                 | 所在地                                          |
|--------------------|----------------------------------------------|
| 福山支店               | 広島県福山市東桜町3-1                                 |
| 徳山支店               | 山口県周南市本町1-3                                  |
| 下関支店               | 山口県下関市細江町1-3-15                              |
| 高松支店               | 香川県高松市古新町10-5                                |
| 徳島支店               | 徳島県徳島市八百屋町3-14                               |
| 高知支店               | 高知県高知市はりまや町1-2-6                             |
| 松山支店               | 愛媛県松山市千舟町5-7-3                               |
| 福岡支店               | 福岡県福岡市中央区天神2-14-8                            |
| 北九州支店              | 福岡県北九州市小倉北区京町3-1-1                           |
| 久留米支店              | 福岡県久留米市日吉町24-18                              |
| 佐賀支店               | 佐賀県佐賀市駅南本町3-15                               |
| 長崎支店               | 長崎県長崎市銅座町6-5                                 |
| 佐世保支店              | 長崎県佐世保市島瀬町7-20                               |
| 熊本支店               | 熊本県熊本市中央区花畑町12-30                            |
| 大分支店               | 大分県大分市中央町1-3-20                              |
| 宮崎支店               | 宮崎県宮崎市橘通東4-1-2                               |
| 鹿児島支店              | 鹿児島県鹿児島市千日町1-4                               |
| 那覇支店               | 沖縄県那覇市松山1-1-19                               |
| プライベートバンキング 銀座オフィス | 東京都中央区銀座5-5-4                                |
| プライベートバンキング 京都オフィス | 京都市中京区河原町通二条南入一之船入町537-4                     |
| 大手町センター            | 東京都千代田区大手町2-2-2                              |
| 江戸橋センター            | 東京都中央区日本橋1-10-1                              |
| 札幌センター             | 北海道札幌市中央区北一条西6-1-2                           |
| 武蔵小杉センター           | 神奈川県川崎市中原区小杉町1-403                           |
| 大手町野村センター          | 東京都千代田区大手町2-1-1                              |
| 那覇旭橋センター           | 沖縄県那覇市旭町 1 1 6 番地 3 7                        |
| 西川センター             | 東京都中央区日本橋一丁目5-3日本橋西川ビル                       |
| 横浜ビジネスパークセンター      | 神奈川県横浜市保土ヶ谷区神戸町134番地<br>(横浜ビジネスパークウエストタワー5F) |
| 新宿BASE             | 東京都新宿区新宿5-17-9 新宿野村證券ビル5F                    |
| 計 1 6 6 店          |                                              |

9. 加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の名称

金融商品取引業協会：日本証券業協会

一般社団法人 日本投資顧問業協会

一般社団法人 金融先物取引業協会

一般社団法人 第二種金融商品取引業協会

認定投資者保護団体：特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター

10. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号

東京証券取引所

大阪取引所

名古屋証券取引所

福岡証券取引所

札幌証券取引所

東京金融取引所

11. 加入する投資者保護基金の名称

日本投資者保護基金

12. 苦情処理及び紛争解決の体制

- ① 第一種金融商品取引業 特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター（「FINMAC」）との間で特定第一種金融商品取引業務に係わる手続実施基本契約を締結する措置
- ② 第二種金融商品取引業 一般社団法人金融先物取引業協会（FINMACに業務委託）を利用する措置、又はFINMACを利用する措置
- ③ 投資助言・代理業 一般社団法人日本投資顧問業協会（FINMACに業務委託）を利用する措置
- ④ 投資運用業 一般社団法人投資信託協会（FINMACに業務委託）を利用する措置

## II. 業務の状況に関する事項

### 1. 当期の業務の概要

当社は、親会社である野村ホールディングス株式会社の傘下会社の一つとして、グループ一体となった連結経営の下で会社運営が行われており、下記に掲げる業績総括は、企業集団としての業績総括を記載いたしております。

当期の世界経済は、先進国、新興国を問わず順調な景気回復が続きました。米国では、実質GDP成長率の2016年からの加速傾向が当期も続きました。米連邦議会は、10年間で1.5兆ドルの大型減税を可決し、2年間で3,000億ドルの大規模な歳出増加で合意するなど、財政政策を大きく拡張させました。内外景気の順調な拡大を背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）は緩やかなペースでの利上げを継続しました。欧州では、上向きの中国経済や堅調な米国経済を背景に輸出の伸びが再加速し、堅調な設備投資もあって、英国を含めて実体経済は良好に推移しました。また、アジア地域は、不動産市況の回復や官民連携方式によるインフラ投資の拡大によって中国経済の成長が加速したほか、他の国でもインフラ投資や規制緩和による事業環境の改善などによって、景気が堅調に推移しています。

一方、日本経済も、堅調な拡大を見せました。米欧における設備投資の循環的な回復や、中国における工場省力化需要の拡大、世界の半導体関連需要の拡大などを背景に、輸出が堅調に推移しました。国内では、省力化需要や建設需要の高まりが国内設備投資の伸びにつながりました。他方で、雇用の伸びは堅調ながら賃金の伸びは全体として鈍く、天候要因もあって個人消費は伸び悩みました。企業業績も堅調で、日本株は世界の主要株式市場と同様に堅調に推移しました。もっとも、下期は米国利上げ加速観測や米中貿易摩擦懸念から市場のボラティリティ（変動性）は高まりました。結局、東証株価指数（TOPIX）は2017年3月末の1,512.60ポイントから、2018年3月末には1,716.30ポイントに、また日経平均株価も2017年3月末の18,909.26円から、2018年3月末には21,454.30円へ上昇しました。また、2017年3月末に1ドル=111円台で終わった円ドル相場は、北朝鮮の軍事的挑発行動など地政学リスクによって上下に振れました。年明け後は米国財政悪化への懸念から大幅なドル安・円高が進行し、2018年3月末には106円台となりました。国債利回りは、日本銀行のYCC（イールド・カーブ・コントロール）政策によって狭いレンジで上下を繰り返しました。2018年3月末に新発10年国債利回りは0.045%となりました。

金融規制に関しては、自己資本比率・流動性比率・レバレッジ比率等、バーゼルⅢと呼ばれる規制の適用に加え、当社は「国内のシステム上重要な銀行」のひとつに指定されており、国内外の金融機関に対する監督強化のための広範囲な規制改革に引き続き注意深く対応することが必要となっております。また、英国の欧州連合離脱（Brexit）に伴う先行き不透明感も見られる中、第2次金融商品市場指令（MiFIDⅡ）施行等を含むグローバルな事業環境の変化に注目し、適切な施策を検討・実施しております。

このように当社を取り巻く環境が大きく変動する中、野村グループでは、「すべてはお客様のために」という基本観のもと、国内におけるビジネスモデルの変革の推進を継続するとともに、海外ビジネスの収益性のさらなる改善に努めてまいりました。また、2018年1月にマーチャント・バンキング部門を新設し、お客様への新たなソリューションとして、事業再編・事業再生・事業承継・MBO等の案件において主にエクイティ等を提供する、プリンシパル・ビジネスを開始しました。

### 経営成績

当期の純営業収益は6,113億86百万円（前期比7.9%増）、経常利益は1,218億39百万円（同20.6%増）、当期純利益は764億39百万円（同6.5%増）となっております。

### 受入手数料

当期の受入手数料は、3,945億87百万円（前期比11.4%増）となりました。内訳は次のとおりです。

#### (1) 委託手数料

東証売買代金は通期で797兆43百億円（前期比16.6%増）となる中、当社の株式委託取引にかかる売買代金は265兆12百億円（同26.5%増）となりました。

また、株式委託手数料は1,148億72百万円（同24.8%増）、委託手数料は合計で1,203億89百万円（同21.7%増）となりました。

#### (2) 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料

当期の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料の合計は、235億13百万円（前期比10.6%減）となりました。前期と比較すると、公募増資の引受け案件数は増加したものの、大型案件が少なかったことなどにより減収となりました。

(3) 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料

当期は、野村インド株投資や野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド等を販売し、受益証券の募集・売出し取扱高は18兆49百億円（前期比3.9%増）と増加しました。

また、受益証券の募集・売出しの取扱手数料は868億24百万円（同5.6%増）となり、募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は合計で892億53百万円（同1.7%増）となりました。

(4) その他の受入手数料

当期は、M&A手数料の増加などにより、合計で1,614億33百万円（前期比14.4%増）となりました。

トレーディング損益

当期のトレーディング損益は、2,228億78百万円（前期比0.9%増）となりました。内訳は次のとおりです。

(1) 株券等トレーディング損益

当期は、米国の財政政策への期待を背景とした堅調な米国株式市場と日本国内の好調な企業業績などにより日経平均株価は通期で11.8%上昇しました。このような良好な市場環境により顧客アクティビティが増加し取引量が増えたことから、株式および派生商品に係るトレーディング収益が増加しました。結果、当期の株券等トレーディング収益は633億90百万円（前期比130.6%増）の利益となりました。

(2) 債券・為替等トレーディング損益

当期は、日本国内の個人消費の伸び悩みや米中貿易摩擦への懸念などから長期金利に対する上昇圧力は限定的になりました。長期金利が国内外ともに低位で推移する市場環境を受けて、金利系デリバティブ関連商品の売買取引が減少し、収益は前期を下回りました。結果、当期の債券・為替等トレーディング損益は1,594億88百万円（前期比17.5%減）となりました。

金融収支

当期の金融収益は、主に有価証券貸借取引収益の減少により723億47百万円（前期比17.6%減）、金融費用は有価証券品借料の減少により784億26百万円（同18.5%減）となりました。結果、金融収支は△60億79百万円となりました。

販売費・一般管理費

当期の販売費・一般管理費は、人件費の増加等により、合計で4,896億24百万円（前期比4.7%増）となりました。



## ２．業務の状況を示す指標

### （１）経営成績等の推移

|                 | 第15期<br>(自 2015年4月～<br>至 2016年3月) | 第16期<br>(自 2016年4月～<br>至 2017年3月) | 第17期<br>(自 2017年4月～<br>至 2018年3月) |
|-----------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 資本金 (百万円)       | 10,000                            | 10,000                            | 10,000                            |
| 発行済株式総数 (千株)    | 201                               | 201                               | 201                               |
| 営業収益 (百万円)      | 746,800                           | 662,831                           | 689,812                           |
| (うち受入手数料) (百万円) | (446,136)                         | (354,155)                         | (394,587)                         |
| 純営業収益 (百万円)     | 659,004                           | 566,586                           | 611,386                           |
| 経常利益 (百万円)      | 184,705                           | 101,038                           | 121,839                           |
| 当期純利益 (百万円)     | 120,544                           | 71,743                            | 76,439                            |

#### ① 受入手数料の内訳

(単位：百万円)

|                                  |                                | 株券      | 債券     | 受益証券    | その他     | 計       |
|----------------------------------|--------------------------------|---------|--------|---------|---------|---------|
| 第15期<br>(自 2015年4月<br>至 2016年3月) | 委託手数料                          | 116,053 | 517    | 11,042  | 115     | 127,728 |
|                                  | 引受け・売出し・特定投資家<br>向け売付け勧誘等の手数料  | 45,034  | 5,805  | —       | —       | 50,839  |
|                                  | 募集・売出し・特定投資家<br>向け売付け勧誘等の取扱手数料 | —       | 2,127  | 94,050  | —       | 96,177  |
|                                  | その他の受入手数料                      | 4,824   | 1,359  | 63,471  | 101,739 | 171,392 |
|                                  | 計                              | 165,911 | 9,808  | 168,562 | 101,854 | 446,136 |
| 第16期<br>(自 2016年4月<br>至 2017年3月) | 委託手数料                          | 92,036  | 512    | 6,296   | 67      | 98,910  |
|                                  | 引受け・売出し・特定投資家<br>向け売付け勧誘等の手数料  | 20,184  | 6,122  | —       | —       | 26,306  |
|                                  | 募集・売出し・特定投資家<br>向け売付け勧誘等の取扱手数料 | —       | 5,615  | 82,181  | —       | 87,796  |
|                                  | その他の受入手数料                      | 3,911   | 1,612  | 57,122  | 78,498  | 141,142 |
|                                  | 計                              | 116,131 | 13,861 | 145,598 | 78,565  | 354,155 |
| 第17期<br>(自 2017年4月<br>至 2018年3月) | 委託手数料                          | 114,872 | 396    | 5,102   | 19      | 120,389 |
|                                  | 引受け・売出し・特定投資家<br>向け売付け勧誘等の手数料  | 17,921  | 5,592  | —       | —       | 23,513  |
|                                  | 募集・売出し・特定投資家<br>向け売付け勧誘等の取扱手数料 | —       | 2,429  | 86,824  | —       | 89,253  |
|                                  | その他の受入手数料                      | 4,837   | 1,573  | 65,341  | 89,681  | 161,433 |
|                                  | 計                              | 137,630 | 9,990  | 157,266 | 89,700  | 394,587 |

② トレーディング損益の内訳

(単位：百万円)

|                                   |                   | 実現損益    | 評価損益    | 計       |
|-----------------------------------|-------------------|---------|---------|---------|
| 第15期<br>(自 2015年4月～<br>至 2016年3月) | 株券等トレーディング損益      | △11,571 | 92,519  | 80,949  |
|                                   | 債券等・その他のトレーディング損益 | 26,905  | 110,832 | 137,737 |
|                                   | (うち債券等トレーディング損益)  | 19,301  | 100,690 | 119,991 |
|                                   | (うちその他のトレーディング損益) | 7,605   | 10,142  | 17,747  |
|                                   | 計                 | 15,335  | 203,352 | 218,686 |
| 第16期<br>(自 2016年4月～<br>至 2017年3月) | 株券等トレーディング損益      | 47,948  | △20,467 | 27,481  |
|                                   | 債券等・その他のトレーディング損益 | 253,359 | △59,989 | 193,370 |
|                                   | (うち債券等トレーディング損益)  | 225,809 | △42,915 | 182,894 |
|                                   | (うちその他のトレーディング損益) | 27,550  | △17,074 | 10,476  |
|                                   | 計                 | 301,307 | △80,456 | 220,851 |
| 第17期<br>(自 2017年4月～<br>至 2018年3月) | 株券等トレーディング損益      | 80,802  | △17,413 | 63,390  |
|                                   | 債券等・その他のトレーディング損益 | 90,858  | 68,630  | 159,488 |
|                                   | (うち債券等トレーディング損益)  | 92,070  | 21,302  | 113,373 |
|                                   | (うちその他のトレーディング損益) | △1,212  | 47,328  | 46,116  |
|                                   | 計                 | 171,660 | 51,217  | 222,878 |

(2) 有価証券引受・売買等の状況

① 株券の売買高の推移

(単位：百万円)

|                        | 受託          | 自己         | 計           |
|------------------------|-------------|------------|-------------|
| 第15期 (2015年4月～2016年3月) | 217,524,557 | 23,221,357 | 240,745,914 |
| 第16期 (2016年4月～2017年3月) | 209,610,187 | 17,794,708 | 227,404,895 |
| 第17期 (2017年4月～2018年3月) | 265,118,234 | 22,275,363 | 287,393,598 |

② 有価証券の引受け及び売出し並びに特定機関投資家向け売付け勧誘等並びに有価証券の募集、売出し及び私募の取扱い並びに特定投資家向け売付け勧誘等の取扱いの状況

(単位：百万円)

| 区分                            |       | 引受高       | 売出高       | 特定投資家向け<br>売付け勧誘等の<br>総額 | 募集の<br>取扱高 | 売出しの<br>取扱高 | 私募の<br>取扱高 | 特定投資家向け<br>売付け勧誘等の<br>取扱高 |
|-------------------------------|-------|-----------|-----------|--------------------------|------------|-------------|------------|---------------------------|
| 第15期<br>(2015年4月～<br>2016年3月) | 株券    | 1,196,957 | 1,303,617 | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 国債証券  | 256,400   | —         | —                        | 252,370    | —           | —          | —                         |
|                               | 地方債証券 | 795,315   | —         | —                        | 7,371      | —           | —          | —                         |
|                               | 特殊債券  | 1,286,156 | —         | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 社債券   | 4,376,123 | 459,551   | —                        | 107,595    | —           | 2,657,700  | 2,356,500                 |
|                               | 受益証券  | —         | —         | —                        | 20,396,568 | —           | 1,336,089  | 8,777                     |
|                               | その他   | —         | —         | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 合計    | 7,910,951 | 1,763,169 | —                        | 20,763,904 | —           | 3,993,789  | 2,365,277                 |
| 第16期<br>(2016年4月～<br>2017年3月) | 株券    | 547,422   | 618,945   | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 国債証券  | —         | —         | —                        | 1,315,630  | —           | —          | —                         |
|                               | 地方債証券 | 836,423   | —         | —                        | 860        | —           | —          | —                         |
|                               | 特殊債券  | 1,103,780 | —         | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 社債券   | 4,969,941 | 429,002   | —                        | —          | —           | 2,506,900  | 2,316,000                 |
|                               | 受益証券  | —         | —         | —                        | 15,815,160 | —           | 1,986,230  | —                         |
|                               | その他   | —         | —         | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 合計    | 7,457,566 | 1,047,948 | —                        | 17,131,650 | —           | 4,493,130  | 2,316,000                 |
| 第17期<br>(2017年4月～<br>2018年3月) | 株券    | 636,956   | 746,345   | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 国債証券  | —         | —         | —                        | 567,937    | —           | —          | —                         |
|                               | 地方債証券 | 859,498   | —         | —                        | 1,647      | —           | —          | —                         |
|                               | 特殊債券  | 1,337,457 | —         | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 社債券   | 4,698,032 | 524,393   | —                        | —          | —           | 2,358,000  | 2,242,000                 |
|                               | 受益証券  | —         | —         | —                        | 17,118,302 | —           | 1,368,625  | —                         |
|                               | その他   | —         | —         | —                        | —          | —           | —          | —                         |
|                               | 合計    | 7,531,944 | 1,270,738 | —                        | 17,687,887 | —           | 3,726,625  | 2,242,000                 |

## (3) その他業務の状況

## ① 保護預り有価証券

|                        |         | 国内有価証券        | 外国有価証券       |
|------------------------|---------|---------------|--------------|
| 第15期<br>(2016年3月31日現在) | 株券      | 63,235,822千株  | 3,156,331千株  |
|                        | 債券      | 13,211,455百万円 | 7,007,996百万円 |
|                        | 受益証券    | 18,811,663百万口 | 805,851百万口   |
|                        | 新株予約権証券 | —             | 27,629個      |
|                        | その他     | 68,473百万円     | —            |
| 第16期<br>(2017年3月31日現在) | 株券      | 59,748,744千株  | 3,142,428千株  |
|                        | 債券      | 12,956,519百万円 | 7,195,179百万円 |
|                        | 受益証券    | 18,443,893百万口 | 705,679百万口   |
|                        | 新株予約権証券 | —             | 26,799個      |
|                        | その他     | 42,439百万円     | —            |
| 第17期<br>(2018年3月31日現在) | 株券      | 44,789,948千株  | 3,930,146千株  |
|                        | 債券      | 13,099,053百万円 | 7,335,447百万円 |
|                        | 受益証券    | 18,001,468百万口 | 717,953百万口   |
|                        | 新株予約権証券 | —             | 12,541個      |
|                        | その他     | 33,410百万円     | —            |

## ② 受入保証金代用有価証券

|                        |      | 国内有価証券    | 外国有価証券    |
|------------------------|------|-----------|-----------|
| 第15期<br>(2016年3月31日現在) | 株券   | 316,777千株 | 37千株      |
|                        | 債券   | 8,823百万円  | 25,910百万円 |
|                        | 受益証券 | 50,629百万口 | 1百万口      |
|                        | その他  | 2,298百万円  | —         |
| 第16期<br>(2017年3月31日現在) | 株券   | 249,357千株 | 21千株      |
|                        | 債券   | 679百万円    | 19,241百万円 |
|                        | 受益証券 | 42,239百万口 | 2百万口      |
|                        | その他  | 1,252百万円  | —         |
| 第17期<br>(2018年3月31日現在) | 株券   | 203,677千株 | 192千株     |
|                        | 債券   | 928百万円    | 6,042百万円  |
|                        | 受益証券 | 41,042百万口 | 2百万口      |
|                        | その他  | 1,096百万円  | —         |

③ 信用取引に係る融資および貸証券

|                        | 顧客の委託に基づいて行った融資額と<br>これにより顧客が買い付けている証券の数量 |         | 顧客の委託に基づいて行った貸証券の数量と<br>これにより顧客が売り付けている代金 |         |
|------------------------|-------------------------------------------|---------|-------------------------------------------|---------|
|                        | 数量（千株）                                    | 金額（百万円） | 数量（千株）                                    | 金額（百万円） |
| 第15期<br>(2016年3月31日現在) | 202,068                                   | 235,181 | 52,942                                    | 46,145  |
| 第16期<br>(2017年3月31日現在) | 175,716                                   | 191,644 | 68,664                                    | 71,979  |
| 第17期<br>(2018年3月31日現在) | 138,008                                   | 264,818 | 30,460                                    | 55,581  |

(注) 数量には、証券投資信託受益証券の「1口」を「1株」として含めております。

当社が行っております上記以外のその他業務の内容につきましては、「Ⅰ. 当社の概況及び組織に関する事項  
7. 業務の種別」をご覧ください。

(4) 自己資本規制比率の状況

(単位：百万円)

|                                      |                         | 第15期<br>(2016年3月31日現在) | 第16期<br>(2017年3月31日現在) | 第17期<br>(2018年3月31日現在) |
|--------------------------------------|-------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| 基本的項目                                | 資本合計 (A)                | 663,554                | 660,292                | 616,726                |
| 補完的項目                                | その他有価証券評価差額金<br>(評価益) 等 | 1,458                  | 667                    | 31                     |
|                                      | 金融商品取引責任準備金等            | 17,926                 | 18,454                 | 21,856                 |
|                                      | 一般貸倒引当金                 | 79                     | —                      | —                      |
|                                      | 劣後債務                    | 409,197                | 409,198                | 360,000                |
|                                      | 計 (B)                   | 428,661                | 428,320                | 381,888                |
| 控除資産 (C)                             |                         | 111,670                | 84,056                 | 48,872                 |
| 固定化されていない自己資本<br>(A) + (B) - (C) (D) |                         | 980,545                | 1,004,557              | 949,742                |
| リスク相当額                               | 市場リスク相当額                | 83,398                 | 68,731                 | 92,856                 |
|                                      | 取引先リスク相当額               | 182,834                | 146,839                | 137,374                |
|                                      | 基礎的リスク相当額               | 142,167                | 137,882                | 140,198                |
|                                      | 計 (E)                   | 408,399                | 353,453                | 370,429                |
| 自己資本規制比率(D) / (E) × 100 (%)          |                         | 240.0                  | 284.2                  | 256.3                  |

(注) 1. 第15期の市場リスク相当額の月末平均額は104,797百万円、月末最大額は120,348百万円、取引先リスク相当額の月末平均額は186,409百万円、月末最大額は201,477百万円であります。

第16期の市場リスク相当額の月末平均額は67,478百万円、月末最大額は76,953百万円、取引先リスク相当額の月末平均額は171,513百万円、月末最大額は189,688百万円であります。

第17期の市場リスク相当額の月末平均額は77,735百万円、月末最大額は92,857百万円、取引先リスク相当額の月末平均額は151,298百万円、月末最大額は161,867百万円であります。

2. 百万円未満を切り捨てて記載しています。

(5) 使用人の総数及び外務員の総数

(単位：名)

|         | 第15期<br>(2016年3月31日現在) | 第16期<br>(2017年3月31日現在) | 第17期<br>(2018年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|------------------------|
| 使用人     | 14,966                 | 15,128                 | 15,252                 |
| (うち外務員) | (13,705)               | (13,914)               | (14,051)               |

### Ⅲ．財産の状況に関する事項

#### 1．経理の状況

##### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

|            | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部       |                       |                       |
| 流動資産       |                       |                       |
| 現金・預金      | 1,230,534             | 961,058               |
| 預託金        | 16,642                | 18,042                |
| トレーディング商品  | 3,387,380             | 3,469,388             |
| 商品有価証券等    | 2,643,696             | 2,689,328             |
| デリバティブ取引   | 743,684               | 780,060               |
| 約定見返勘定     | 237,706               | 450,274               |
| 信用取引資産     | 215,875               | 271,989               |
| 信用取引貸付金    | 191,644               | 264,818               |
| 信用取引借証券担保金 | 24,230                | 7,171                 |
| 有価証券担保貸付金  | 6,326,190             | 6,025,130             |
| 借入有価証券担保金  | 5,837,305             | 5,482,432             |
| 現先取引貸付金    | 488,885               | 542,698               |
| 立替金        | 1,589                 | 3,320                 |
| 短期差入保証金    | 1,380,898             | 1,514,331             |
| 短期貸付金      | 2,844                 | 2,241                 |
| 繰延税金資産     | 41,427                | 35,023                |
| その他の流動資産   | 52,450                | 41,861                |
| 流動資産計      | 12,893,533            | 12,792,656            |
| 固定資産       |                       |                       |
| 有形固定資産     | 1,328                 | 1,307                 |
| 無形固定資産     | 302                   | 259                   |
| 投資その他の資産   | 59,949                | 30,566                |
| 繰延税金資産     | 4,798                 | 6,091                 |
| 前払年金費用     | 9,539                 | 8,130                 |
| その他        | 46,671                | 17,375                |
| 貸倒引当金      | △1,059                | △1,030                |
| 固定資産計      | 61,579                | 32,132                |
| 資産合計       | 12,955,112            | 12,824,789            |

(単位：百万円)

|             | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部        |                       |                       |
| 流動負債        |                       |                       |
| トレーディング商品   | 3,089,670             | 3,048,477             |
| 商品有価証券等     | 2,567,121             | 2,521,508             |
| デリバティブ取引    | 522,549               | 526,970               |
| 信用取引負債      | 75,382                | 59,379                |
| 信用取引借入金     | 3,404                 | 3,799                 |
| 信用取引貸証券受入金  | 71,979                | 55,581                |
| 有価証券担保借入金   | 5,221,154             | 5,129,050             |
| 有価証券貸借取引受入金 | 1,414,615             | 1,263,508             |
| 現先取引借入金     | 3,806,540             | 3,865,541             |
| 預り金         | 537,589               | 562,315               |
| 受入保証金       | 802,672               | 861,503               |
| 短期借入金       | 433,500               | 490,719               |
| 関係会社短期借入金   | 695,983               | 705,041               |
| 短期社債        | —                     | 173,000               |
| 一年以内償還社債    | 49,199                | —                     |
| 未払法人税等      | 3,040                 | 8,476                 |
| 未払金         | 17,803                | 15,295                |
| 賞与引当金       | 43,960                | 44,727                |
| その他の流動負債    | 61,362                | 51,588                |
| 流動負債計       | 11,031,314            | 11,149,571            |
| 固定負債        |                       |                       |
| 社債          | 4,700                 | 4,700                 |
| 長期借入金       | 752,679               | 689,651               |
| 関係会社長期借入金   | 250,000               | 175,000               |
| 退職給付引当金     | 30,139                | 32,148                |
| 資産除去債務      | 5,033                 | 5,103                 |
| その他の固定負債    | 126,827               | 85,000                |
| 固定負債計       | 1,169,378             | 991,602               |
| 特別法上の準備金    |                       |                       |
| 金融商品取引責任準備金 | 18,455                | 21,856                |
| 特別法上の準備金計   | 18,455                | 21,856                |
| 負債合計        | 12,219,147            | 12,163,030            |
| 純資産の部       |                       |                       |
| 株主資本        |                       |                       |
| 資本金         | 10,000                | 10,000                |
| 資本剰余金       |                       |                       |
| 資本準備金       | 529,579               | 529,579               |
| その他資本剰余金    | 45,067                | 45,067                |
| 資本剰余金合計     | 574,646               | 574,646               |
| 利益剰余金       |                       |                       |
| その他利益剰余金    |                       |                       |
| 別途積立金       | 63,000                | —                     |
| 繰越利益剰余金     | 87,652                | 77,081                |
| 利益剰余金合計     | 150,652               | 77,081                |
| 株主資本合計      | 735,298               | 661,727               |
| 評価・換算差額等    |                       |                       |
| 繰延ヘッジ損益     | 668                   | 32                    |
| 評価・換算差額等合計  | 668                   | 32                    |
| 純資産合計       | 735,965               | 661,758               |
| 負債・純資産合計    | 12,955,112            | 12,824,789            |



## (2) 損益計算書

(単位：百万円)

|               | 前事業年度<br>(自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) |
|---------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益          |                                        |                                        |
| 受入手数料         | 354,155                                | 394,587                                |
| トレーディング損益     | 220,851                                | 222,878                                |
| 金融収益          | 87,826                                 | 72,347                                 |
| 営業収益計         | 662,831                                | 689,812                                |
| 金融費用          | 96,246                                 | 78,426                                 |
| 純営業収益         | 566,586                                | 611,386                                |
| 販売費・一般管理費     |                                        |                                        |
| 取引関係費         | 94,070                                 | 100,632                                |
| 人件費           | 184,372                                | 190,304                                |
| 不動産関係費        | 40,548                                 | 40,544                                 |
| 事務費           | 136,099                                | 145,513                                |
| 減価償却費         | 192                                    | 179                                    |
| 租税公課          | 6,554                                  | 6,608                                  |
| その他           | 5,970                                  | 5,845                                  |
| 販売費・一般管理費計    | 467,804                                | 489,624                                |
| 営業利益          | 98,782                                 | 121,762                                |
| 営業外収益         | 2,955                                  | 425                                    |
| 営業外費用         | 699                                    | 347                                    |
| 経常利益          | 101,038                                | 121,839                                |
| 特別利益          |                                        |                                        |
| 株式報酬受入益       | 1,558                                  | 1,647                                  |
| 特別利益計         | 1,558                                  | 1,647                                  |
| 特別損失          |                                        |                                        |
| 金融商品取引責任準備金繰入 | 528                                    | 3,402                                  |
| 特別損失計         | 528                                    | 3,402                                  |
| 税引前当期純利益      | 102,068                                | 120,084                                |
| 法人税、住民税及び事業税  | 29,648                                 | 38,249                                 |
| 法人税等調整額       | 677                                    | 5,396                                  |
| 当期純利益         | 71,743                                 | 76,439                                 |

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

（単位：百万円）

|                         | 株主資本    |          |              |             |          |             |             | 株主資本<br>合計 |
|-------------------------|---------|----------|--------------|-------------|----------|-------------|-------------|------------|
|                         | 資本金     | 資本剰余金    |              |             | 利益剰余金    |             |             |            |
|                         |         | 資本準備金    | その他<br>資本剰余金 | 資本剰余金<br>合計 | その他利益剰余金 |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                         |         |          |              |             | 別途積立金    | 繰越利益<br>剰余金 |             |            |
| 当期首残高                   | 10, 000 | 529, 579 | 45, 067      | 574, 646    | 63, 000  | 155, 909    | 218, 909    | 803, 555   |
| 当期変動額                   |         |          |              |             |          |             |             |            |
| 剰余金の配当                  |         |          |              |             |          | △140, 000   | △140, 000   | △140, 000  |
| 当期純利益                   |         |          |              |             |          | 71, 743     | 71, 743     | 71, 743    |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） |         |          |              |             |          |             |             |            |
| 当期変動額合計                 | －       | －        | －            | －           | －        | △68, 257    | △68, 257    | △68, 257   |
| 当期末残高                   | 10, 000 | 529, 579 | 45, 067      | 574, 646    | 63, 000  | 87, 652     | 150, 652    | 735, 298   |

|                         | 評価・換算差額等             |             |                | 純資産合計    |
|-------------------------|----------------------|-------------|----------------|----------|
|                         | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・換算<br>差額等合計 |          |
| 当期首残高                   | △0                   | 1,459       | 1,459          | 805,013  |
| 当期変動額                   |                      |             |                |          |
| 剰余金の配当                  |                      |             |                | △140,000 |
| 当期純利益                   |                      |             |                | 71,743   |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） | 0                    | △791        | △791           | △791     |
| 当期変動額合計                 | 0                    | △791        | △791           | △69,048  |
| 当期末残高                   | —                    | 668         | 668            | 735,965  |

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：百万円）

|                         | 株主資本   |         |              |             |          |             |             | 株主資本<br>合計 |
|-------------------------|--------|---------|--------------|-------------|----------|-------------|-------------|------------|
|                         | 資本金    | 資本剰余金   |              |             | 利益剰余金    |             |             |            |
|                         |        | 資本準備金   | その他<br>資本剰余金 | 資本剰余金<br>合計 | その他利益剰余金 |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                         |        |         |              |             | 別途積立金    | 繰越利益<br>剰余金 |             |            |
| 当期首残高                   | 10,000 | 529,579 | 45,067       | 574,646     | 63,000   | 87,652      | 150,652     | 735,298    |
| 当期変動額                   |        |         |              |             |          |             |             |            |
| 剰余金の配当                  |        |         |              |             | △63,000  | △87,010     | △150,010    | △150,010   |
| 当期純利益                   |        |         |              |             |          | 76,439      | 76,439      | 76,439     |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） |        |         |              |             |          |             |             |            |
| 当期変動額合計                 | －      | －       | －            | －           | △63,000  | △10,571     | △73,571     | △73,571    |
| 当期末残高                   | 10,000 | 529,579 | 45,067       | 574,646     | －        | 77,081      | 77,081      | 661,727    |

|                         | 評価・換算差額等    |                | 純資産合計    |
|-------------------------|-------------|----------------|----------|
|                         | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・換算<br>差額等合計 |          |
| 当期首残高                   | 668         | 668            | 735,965  |
| 当期変動額                   |             |                |          |
| 剰余金の配当                  |             |                | △150,010 |
| 当期純利益                   |             |                | 76,439   |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） | △636        | △636           | △636     |
| 当期変動額合計                 | △636        | △636           | △74,207  |
| 当期末残高                   | 32          | 32             | 661,758  |

#### (4) 注記事項

当社の貸借対照表、損益計算書および株主資本変動計算書は、「会社計算規則」（平成18年法務省令第13号）のほか「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）および「有価証券関連業経理の統一に関する規則」（昭和49年日本証券業協会自主規制規則）に準拠して作成しております。  
記載金額は、百万円未満を四捨五入して表示しております。

#### [重要な会計方針]

##### 1. 有価証券およびデリバティブ取引等の評価基準および評価方法

当社は金融商品取引業の一環として自己の計算で有価証券およびデリバティブ取引等（以下、有価証券等という）の売買、引受を行い、その結果として有価証券等のポジションを保有し、トレーディング商品として計上しております。有価証券等については、時価法を採用しております。

##### 2. 固定資産の減価償却の方法

###### (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）ならびに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備および構築物については、定額法を採用しております。

###### (2) 無形固定資産および投資その他の資産

定額法を採用しております。なお、のれんについては、5年間の均等償却を行っております。

##### 3. 引当金および準備金の計上基準

###### (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、また、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

###### (2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、当社所定の計算方法による支払見込額を計上しております。

###### (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職一時金および確定給付企業年金について、当期末における退職給付債務および年金資産の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。退職給付債務および勤務費用の算定にあたり、退職給付見込額を当期末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異ならびに過去勤務費用のうち確定給付企業年金にかかるものは、その発生時の従業員の平均残存勤務年数（11年～16年）による定額法により発生した会計年度から費用処理しております。

退職一時金にかかるものは、発生した会計年度において一括費用処理しております。

なお、当期末において認識すべき年金資産が、退職給付債務から数理計算上の差異等を控除した額を超過する場合には、前払年金費用として投資その他の資産に計上しております。

###### (4) 金融商品取引責任準備金

証券事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5および金融商品取引業等に関する内閣府令第175条に定めるところにより算出した額を計上しております。

4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. ヘッジ会計の方法

(1)ヘッジ会計の方法

ヘッジ会計は、原則として、時価評価されているヘッジ手段にかかる損益または評価差額をヘッジ対象にかかる損益が認識されるまで繰り延べる方法によっております。

(2)ヘッジ手段とヘッジ対象

当社の借入金にかかる金利変動リスクをヘッジするため、金利スワップ取引を行っております。

(3)ヘッジ方針

借入金にかかる金利変動リスクは、原則として借入元本について全額、満期日までの期間にわたりヘッジしております。

(4)ヘッジ有効性評価の方法

金利変動リスクのヘッジにつきましては、該当するリスク減殺効果を対応するヘッジ手段ならびにヘッジ対象ごとに定期的に把握し、ヘッジの有効性を検証しております。

6. 消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

7. 連結納税制度を適用しております。

8. 金融資産と金融負債の相殺表示

当社は、金融商品会計に関する実務指針（日本公認会計士協会 会計制度委員会報告第14号）に定める要件を満たす場合に、信用リスク軽減の効果をより明瞭に表示するため金融資産と金融負債を相殺して表示しております。

(1)デリバティブ取引の相殺表示

法的に有効なマスターネットティング契約を有する同一相手先に対する金利等のスワップ取引については相殺して表示しております。

(2)現金担保付債券貸借取引の相殺表示

同一相手先かつ同一決済日など一定の要件を満たした現金担保付債券貸借取引については相殺して表示しております。

[貸借対照表に関する注記]

1 関係会社に対する金銭債権および金銭債務

|                | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 関係会社に対する短期金銭債権 | 169,072百万円            | 150,463百万円            |
| 関係会社に対する短期金銭債務 | 724,853               | 709,702               |
| 関係会社に対する長期金銭債務 | 250,000               | 175,000               |

2 有形固定資産の減価償却累計額

|         | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 減価償却累計額 | 673百万円                | 727百万円                |

3 担保に供している資産

|            | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 担保に供している資産 |                       |                       |
| トレーディング商品  | 511,851百万円            | 444,267百万円            |
| 担保にかかる債務   |                       |                       |
| 短期借入金      | 377,500百万円            | 328,800百万円            |
| 長期借入金      | 113,000               | 102,000               |
| 信用取引借入金    | 3,404                 | 3,799                 |
| 計          | 493,904               | 434,599               |

なお、このほかに前事業年度において借入有価証券および担保受入有価証券を18,927百万円、当事業年度において借入有価証券および担保受入有価証券を28,230百万円差し入れております。

4 差入有価証券等

- ① 有価証券を担保とした金融取引、有価証券の消費貸借契約、信用取引に係るもの、および、保証金等の代用等として差し入れた有価証券、または受け入れた有価証券の時価額（上記3に属するものを除く）

|                    | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|--------------------|-----------------------|-----------------------|
| 差し入れた有価証券の合計額      | 6,195,679百万円          | 6,058,671百万円          |
| うち主なもの             |                       |                       |
| 現先取引で売却した有価証券      | 3,824,978             | 3,883,570             |
| 消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 1,735,240             | 1,680,191             |
| 受け入れた有価証券の合計額      | 7,991,001百万円          | 7,402,452百万円          |
| うち主なもの             |                       |                       |
| 消費貸借契約により借り入れた有価証券 | 6,883,508             | 6,334,040             |
| デリバティブ取引に係る担保      | 209,731               | 164,308               |
| 現先取引で買い付けた有価証券     | 485,165               | 542,270               |

- ② このほか、顧客分別金信託として前事業年度において有価証券を679,075百万円、当事業年度において有価証券を713,542百万円信託しております。

## 5 借入金中の劣後特約付借入金および社債中の劣後特約付社債

|           | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 短期借入金     | 一百万円                  | 110,000百万円            |
| 長期借入金     | 110,000               | —                     |
| 関係会社短期借入金 | —                     | 75,000                |
| 関係会社長期借入金 | 250,000               | 175,000               |
| 一年以内償還社債  | 49,199                | —                     |

## 6 保証債務（注1）

前事業年度（2017年3月31日）

ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンスN.V.が発行したミディアム・ターム・ノート500千豪ドル、43,650百万円の元利金の保証

43,693百万円（注2）

ノムラ・インターナショナルPLCが行うデリバティブ取引等872,241千米ドル、同社が行うレポ取引に伴う20,751千米ドルの保証

99,899百万円（注2）

ノムラ・バンク・インターナショナルPLCが発行したミディアム・ターム・ノート20,840千米ドル、77,642千ユーロ、6,412百万円の元利金の保証

18,018百万円

ノムラ・ファイナンシャル・インベストメント（コリア）Co., Ltd.が行うデリバティブ取引等6,742千米ドルの保証

754百万円

ノムラ・セキュリティーズ・インターナショナルInc.が行うレポ取引等116,640千米ドルの保証

13,049百万円

ノムラ・グローバル・ファイナンシャル・プロダクツInc.が行うスワップ取引等117,948千米ドルの保証

13,195百万円（注2）

ノムラ・インターナショナル・ファンディングPte. Ltd.が発行したミディアム・ターム・ノート503,330千米ドル、2,500千ユーロ、2,550千ポンド、24,730千豪ドル、1,630千シンガポールドル、2,910千ニュージーランドドル、9,000千中国元の元利金の保証

59,581百万円

野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービシズ株式会社が行うデリバティブ取引等68,057千米ドルの保証

7,614百万円（注2）

当事業年度（2018年3月31日）

|                                                                                                                                                     |                |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンスN.V.が発行したミディアム・ターム・ノート36,400百万円の元利金の保証                                                                                              | 36,400百万円（注2）  |
| ノムラ・インターナショナルPLCが行うデリバティブ取引等1,121,269千米ドルの保証                                                                                                        | 119,068百万円（注2） |
| ノムラ・バンク・インターナショナルPLCが発行したミディアム・ターム・ノート20,840千米ドル、5,812百万円の元利金の保証                                                                                    | 8,025百万円       |
| ノムラ・ファイナンシャル・インベストメント（コリア）Co., Ltd.が行うデリバティブ取引等16,705千米ドルの保証                                                                                        | 1,774百万円       |
| ノムラ・セキュリティーズ・インターナショナルInc.が行うレポ取引等237,851千米ドルの保証                                                                                                    | 25,257百万円      |
| ノムラ・グローバル・ファイナンシャル・プロダクツInc.が行うデリバティブ取引等351,812千米ドルの保証                                                                                              | 37,359百万円（注2）  |
| ノムラ・インターナショナル・ファンディングPte. Ltd.が発行したミディアム・ターム・ノート544,460千米ドル、2,500千ユーロ、3,100千ポンド、47,310千豪ドル、10,210千ニュージーランドドル、70,000千香港ドル、330千シンガポールドル、190百万円の元利金の保証 | 64,414百万円      |
| 野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービス株式会社が行うデリバティブ取引等101,697千米ドルの保証                                                                                                 | 10,799百万円（注2）  |

（注1） 日本公認会計士協会監査・保証実務委員会実務指針第61号に従い、実質的に債務保証義務を負っていると認められるものについては、債務保証に準ずるものとして注記の対象に含めております。

（注2） 野村ホールディングス株式会社と連帯して保証する債務を含んでおります。



[損益計算書に関する注記]

関係会社との取引高

|                  | 前事業年度<br>(自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) |
|------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益             | 8,410百万円                               | 8,911百万円                               |
| 金融費用および販売費・一般管理費 | 174,490                                | 199,929                                |
| 営業取引以外の取引高       | 116                                    | 178                                    |

[株主資本等変動計算書に関する注記]

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類   | 当事業年度期首 | 増 加 | 減 少 | 当事業年度末  |
|---------|---------|-----|-----|---------|
| 普通株式（株） | 201,410 | —   | —   | 201,410 |

2 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議                 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日        | 効力発生日     |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|-----------|
| 2016年4月27日<br>取締役会 | 普通株式  | 140,000         | 695,100         | 2016年3月31日 | 2016年6月1日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの

| 決議                 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日        | 効力発生日     |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|-----------|
| 2017年4月27日<br>取締役会 | 普通株式  | 75,005          | 372,400         | 2017年3月31日 | 2017年6月1日 |

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類   | 当事業年度期首 | 増 加 | 減 少 | 当事業年度末  |
|---------|---------|-----|-----|---------|
| 普通株式（株） | 201,410 | —   | —   | 201,410 |

2 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議                  | 株式の種類 | 配当金の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|---------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2017年4月27日<br>取締役会  | 普通株式  | 75,005          | 372,400         | 2017年3月31日 | 2017年6月1日  |
| 2017年10月30日<br>取締役会 | 普通株式  | 75,005          | 372,400         | 2017年9月30日 | 2017年12月1日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

| 決議                 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日        | 効力発生日     |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|-----------|
| 2018年4月26日<br>取締役会 | 普通株式  | 45,000          | 223,425         | 2018年3月31日 | 2018年6月1日 |

[税効果会計に関する注記]

繰延税金資産および負債の発生的主要原因別内訳

|                 | 前事業年度<br>(2017年3月31日) | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産          |                       |                       |
| 賞与引当金           | 14,769百万円             | 15,367百万円             |
| 有価証券・デリバティブ     | 18,719                | 16,184                |
| 退職給付引当金         | 6,386                 | 7,446                 |
| 金融商品取引責任準備金     | 5,721                 | 6,775                 |
| 未払事業税           | 645                   | 1,717                 |
| 固定資産評価減         | 1,264                 | 1,249                 |
| 資産除去債務計上否認      | 1,560                 | 1,582                 |
| その他             | 1,687                 | 1,817                 |
| 繰延税金資産小計        | 50,751                | 52,136                |
| 評価性引当額          | △2,433                | △9,223                |
| 繰延税金資産合計        | 48,318                | 42,913                |
| 繰延税金負債          |                       |                       |
| 繰延ヘッジ損益         | △300                  | △14                   |
| 資産除去債務に対応する除去費用 | △391                  | △383                  |
| その他             | △1,402                | △1,402                |
| 繰延税金負債合計        | △2,093                | △1,799                |
| 繰延税金資産の純額       | 46,225                | 41,114                |

[リースにより使用する固定資産に関する注記]

貸借対照表上に計上した固定資産のほか、事務機器・自動車等の一部については、所有権移転外ファイナンス・リース契約により使用しております。

## [金融商品に関する注記]

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

当社、当社の親会社（野村ホールディングス株式会社）およびその関係会社の主たる事業は証券業を中核とする投資・金融サービス業であり、わが国をはじめ世界の主要な金融資本市場を網羅する営業拠点等を通じ、お客様に対し資金調達、資金運用の両面で幅広いサービスを提供しております。これらの事業を行うため、当社は、有価証券等の売買取引のほか、デリバティブ取引についても、原則として、顧客のさまざまなニーズに対応した商品、取引等を提供していくための業務として、取り組んでおります。そのために生じるトレーディング・ポジションにかかるリスク管理は極めて重要であり、トレーディング部門内のリスク管理に加え、独立したリスク管理部署によるグローバルベースでのリスク管理に注力しております。また、デリバティブ取引は、顧客のさまざまなニーズに対する商品として利用しているほか、トレーディング業務の遂行に付随して発生するリスクのヘッジ、調節等の目的でもデリバティブ取引を利用しており、有価証券等の売買とデリバティブ取引を一体として運営、管理しております。

#### (2) 金融商品の内容およびそのリスク

当社のトレーディング・ポジションは、顧客ニーズに対応する取引、市場機能を補完するためのマーケットメーカー取引、自己の計算にかかるディーリング業務等から発生いたします。

取引所で行う取引の結果として、上場株式、新株予約権付社債、株価指数の先物およびオプション取引、債券先物取引等のポジションを保有しております。取引所取引の先物、オプション等のデリバティブ取引のポジションは、取引所での市場機能の補完や当社の商品有価証券等のヘッジおよび裁定取引の結果として発生しております。

また、取引所以外の取引の結果として、債券、ワラント、選択権付債券売買取引、エクイティ・デリバティブ取引、有価証券貸借取引および現先取引等のポジションを保有しております。さらに、為替取引、通貨先物、金利・通貨スワップ取引等のポジションを保有しておりますが、これらは顧客の抱える為替・金利等のリスクのヘッジやリスクの変換ニーズに対応して発生したポジションおよび当社の商品有価証券等のヘッジ目的によるポジションであります。

トレーディング業務に伴って発生し、当社の財務状況に大きな影響を与えるリスクとしては、主としてマーケットリスクと信用リスク（発行体リスク、取引先リスク）、流動性リスクがあげられます。

#### (3) 金融商品にかかるリスク管理体制

##### ① マーケットリスク管理

株式、金利、為替等の相場変動に伴ってトレーディング・ポジションの価値（時価額）は増減いたします。当社は、この価値の増減をマーケットリスクとして認識しております。当社のトレーディング・ポジションは、主として顧客取引の結果として発生しており、相場変動によりトレーディング・ポジションの価値が減少するリスクを回避するため、適切なヘッジ取引を行っております。ヘッジの手段は、現物有価証券だけに限らずデリバティブ取引も含めてその時点で最適なものが選択されます。したがって、ヘッジ手段まで含めたトレーディング・ポートフォリオについて、日々時価評価を行いマーケットリスクを計算するなど、ルールに沿ったポジション運営がなされております。トレーディング・ポートフォリオは各商品部門で商品別あるいは取引目的別に管理されているほか、トレーディング部門から独立したリスク・マネジメント部門がグローバルベースで日々独自に評価をチェックし、リスク額等を関係執行役に報告しております。マーケットリスクの管理に関するルールは、野村ホールディングス株式会社の統合リスク管理会議で決定されます。

##### ② 信用リスク（発行体リスクおよび取引先リスク）管理

発行体リスクおよび取引先リスクは、当社が有価証券を保有している場合や取引先に対する債権を保有している場合に、発行体や取引先が義務を履行しないリスクであります。典型的には、発行体や取引先がデフォルト状態となった時に発生します。

有価証券の発行体リスクは、市場価格に反映され、日々時価評価されております。しかし、格付けの引下げによる急激な価格変動および発行体のデフォルト時に発生する損失は、発生する可能性としては低いものの、一旦発生した場合の損失見込額は大きく、リスク管理上、非常に重要と認識しております。当社は発行体の格下げやデフォルトの発生確率および発生時の損失見込額を合理的に算出し、トレーディング部門とリスク・マネジメント部門の双方で保有有価証券のポートフォリオを注意深く監視しております。

デリバティブ取引のうち取引所取引は、取引所と日々決済が行われ、また、当社に取引所取引を委託する顧客からは十分な委託証拠金（担保）を徴求しておりますので、取引先リスクは少額であると認識しております。他方、取引所以外でのデリバティブ取引については、与信に相当する取引先リスクが発生します。当社では、リスク・マネジメント部門が取引先の信用度に応じて与信限度額を設定しモニタリングを行っております。取引先リスクは、デリバティブ取引を時価評価して得られる与信相当額と契約終了時までの潜在的与信相当額の合計額で

管理されており、必要に応じて担保の徴求等を行うなど与信相当額を低減するための対策を講じております。また、デリバティブ取引に関する基本契約書の整備にも注力しております。

### ③ 資金流動性リスク管理

当社では、資金流動性リスクを野村グループの信用力の低下または市場環境の悪化により必要な資金の確保が困難になる、または通常より著しく高い金利での資金調達を余儀なくされることにより損失を被るリスクと定義しております。このリスクは、市場において有担保あるいは無担保調達が不可能になる、野村グループの信用力が低下する、予定外の資金需要の変化に対応できない、迅速かつ最小の損失での資産の流動化ができない、あるいは、グループ会社間の自由な資金移動が妨げられる規制資本上の制約に関する変化等、市場全体の事情や野村グループ固有の事情により発生します。資金流動性リスク管理については、野村ホールディングス株式会社の経営会議が定める流動性リスク・アピタイトに基づくことを基本方針としており、野村ホールディングス株式会社が統合管理しております。野村グループの資金流動性管理は、市場全体が流動性ストレス下にある場合において、またそれに加えて野村グループの信用リスクに過度なストレスを想定した場合においても、それぞれ1年間、および1ヶ月間にわたり、無担保による資金調達が困難な場合においても、保有資産を維持しつつ業務を継続することができる十分な資金流動性を常に確保することを主な目的としております。また、金融庁の定める流動性カバレッジ比率（「金融商品取引法第五十七条の十七第一項の規定に基づき、最終指定親会社が当該最終指定親会社およびその子法人等の経営の健全性を判断するための基準として定める最終指定親会社およびその子法人等の経営の健全性のうち流動性にかかる健全性の状況を表示する基準」）の充足が求められております。

当社は、主な流動性維持の目的を達成可能とする、さまざまな流動性リスク管理フレームワークを定めております。このフレームワークには、（1）余剰資金の確保、（2）資産構成等に見合った資金調達ならびに調達手段の多様化および調達期間の分散、（3）金融機関が当社に対し設定する与信枠の維持・管理、（4）コンティンジェンシー・ファンディング・プランに関することが含まれております。

### （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、「2. 金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

### （5）マーケットリスクにかかる定量的情報

#### トレーディング目的の金融商品

当社では、「トレーディング商品（資産および負債）」、「有価証券担保貸付金」ならびに「有価証券担保借入金」に関し、マーケットリスクの測定方法として、バリュアットリスク（VaR）を採用しております。

VaRとして知られる統計的な手法は、ある一定期間に一定の信頼水準内で、市場の変動により発生しうる損失額と定義されます。当社では、トレーディング・ポートフォリオについて、信頼水準99%、保有期間1日のVaRを計測しています。VaRモデルに含まれるマーケットリスクは、株価、金利、外国為替レート、およびそれらに関連するボラティリティや相関等があります。ボラティリティと相関の計算に利用されるヒストリカル・データは、直近のデータに比重をかけて計算されています。

VaR算出における当社のトレーディング・ポジションのリスクの計量化に関しては、多くの前提と近似値が用いられます。当社の用いる前提や近似値あるいはそれらの組み合わせは合理的なものと考えておりますが、前提や近似値が異なれば、VaRの値が大きく異なる可能性があります。

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

① VaRの前提

- ・信頼水準：99%
- ・保有期間：1日
- ・商品の価格変動等を考慮

② VaRの実績

|                | 2017年3月31日現在（億円） |
|----------------|------------------|
| 株式関連           | 4                |
| 金利関連           | 13               |
| 為替関連等          | 3                |
| 小計             | 20               |
| 分散効果           | △6               |
| バリュアットリスク（VaR） | 14               |

|                | 自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日 |         |         |
|----------------|-----------------------------|---------|---------|
|                | 最大値（億円）                     | 最小値（億円） | 平均値（億円） |
| バリュアットリスク（VaR） | 29                          | 9       | 15      |

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

① VaRの前提

- ・信頼水準：99％
- ・保有期間：1日
- ・商品の価格変動等を考慮

② VaRの実績

|                | 2018年3月31日現在（億円） |
|----------------|------------------|
| 株式関連           | 6                |
| 金利関連           | 13               |
| 為替関連等          | 3                |
| 小計             | 22               |
| 分散効果           | △7               |
| バリュアットリスク（VaR） | 15               |

|                | 自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日 |         |         |
|----------------|-----------------------------|---------|---------|
|                | 最大値（億円）                     | 最小値（億円） | 平均値（億円） |
| バリュアットリスク（VaR） | 22                          | 9       | 15      |

なお、当社は、バックテストを実施し、トレーディング・ポートフォリオのVaRの値と実際の損益とを比較し、リスク計測に利用されるモデルの精度を検証しています。VaRを超過する損益の回数をカウントし、所定の回数に収まっているかを検証します。超過回数が所定の基準を上回った場合は、VaRメソドロジの調整を行います。

トレーディング目的以外の金融商品

主要な市場リスクにかかるリスク変数が貸借対照表の時価に与える影響に重要性がないため開示を省略しております。

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（2017年３月31日）

（単位：百万円）

|                            | 貸借対照表計上額   | 時価         | 差額    |
|----------------------------|------------|------------|-------|
| (1)現金・預金                   | 1,230,534  | 1,230,534  | —     |
| (2)預託金                     | 16,642     | 16,642     | —     |
| (3)トレーディング商品               | 3,387,380  | 3,387,380  | —     |
| 商品有価証券等                    | 2,643,696  | 2,643,696  | —     |
| デリバティブ取引                   | 743,684    | 743,684    | —     |
| (4)約定見返勘定                  | 237,706    | 237,706    | —     |
| (5)信用取引資産                  | 215,875    | 215,875    | —     |
| 信用取引貸付金                    | 191,644    | 191,644    | —     |
| 信用取引借証券担保金                 | 24,230     | 24,230     | —     |
| (6)有価証券担保貸付金               | 6,326,190  | 6,326,190  | —     |
| 借入有価証券担保金                  | 5,837,305  | 5,837,305  | —     |
| 現先取引貸付金                    | 488,885    | 488,885    | —     |
| (7)立替金                     | 1,589      | 1,589      | —     |
| (8)短期差入保証金                 | 1,380,898  | 1,380,898  | —     |
| (9)短期貸付金                   | 2,844      | 2,844      | —     |
| 資産計                        | 12,799,658 | 12,799,658 | —     |
| (1)トレーディング商品               | 3,089,670  | 3,089,670  | —     |
| 商品有価証券等                    | 2,567,121  | 2,567,121  | —     |
| デリバティブ取引                   | 522,549    | 522,549    | —     |
| (2)信用取引負債                  | 75,382     | 75,382     | —     |
| 信用取引借入金                    | 3,404      | 3,404      | —     |
| 信用取引貸証券受入金                 | 71,979     | 71,979     | —     |
| (3)有価証券担保借入金               | 5,221,154  | 5,221,154  | —     |
| 有価証券貸借取引受入金                | 1,414,615  | 1,414,615  | —     |
| 現先取引借入金                    | 3,806,540  | 3,806,540  | —     |
| (4)預り金                     | 537,589    | 537,589    | —     |
| (5)受入保証金                   | 802,672    | 802,672    | —     |
| (6)短期借入金                   | 433,500    | 433,500    | —     |
| (7)関係会社短期借入金               | 695,983    | 695,983    | —     |
| (8)未払金                     | 17,803     | 17,803     | —     |
| (9)一年以内償還社債                | 49,199     | 50,145     | 946   |
| (10)社債                     | 4,700      | 5,529      | 829   |
| (11)長期借入金                  | 752,679    | 752,452    | △227  |
| (12)関係会社長期借入金              | 250,000    | 254,766    | 4,766 |
| 負債計                        | 11,930,331 | 11,936,645 | 6,314 |
| ヘッジ会計が適用されていない<br>デリバティブ取引 |            |            |       |
| 資産                         | 27,928     | 27,928     | —     |
| 負債                         | 27,928     | 27,928     | —     |
| ヘッジ会計が適用されている<br>デリバティブ取引  |            |            |       |
| 資産                         | 1,030      | 1,030      | —     |
| 負債                         | —          | —          | —     |



## 資産

### (1) 現金・預金

満期のない預金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある預金については、当期末該当ございません。

### (2) 預託金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

### (3) トレーディング商品（資産および負債）

商品有価証券等の時価は、一般的に市場取引価格、もしくは合理的な水準の価格客観性を持つ業者間取引価格、変数が直接観察可能な類似の金融商品を参照して得た価格に基づいております。商品有価証券等のなかには流動性の低い商品が含まれており、そのような商品に関しては当社による最善の見積公正価値を利用して価格決定がなされております。

デリバティブ取引は、上場デリバティブおよび店頭取引デリバティブで構成されております。上場デリバティブの時価は、市場取引価格または評価モデルによって決定されます。店頭取引デリバティブは、評価モデルを使用して価格評価がなされます。

#### ① 商品有価証券等の貸借対照表計上額

(単位：百万円)

| 種類      | 資産        | 負債        |
|---------|-----------|-----------|
| 株式・ワラント | 148,963   | 301,024   |
| 債券      | 2,341,987 | 2,262,965 |
| 受益証券等   | 152,746   | 3,132     |

(注) トレーディング損益に含まれた評価差額（損）は、80,456百万円であります。

#### ② デリバティブ取引の契約額および時価

(単位：百万円)

| 種類      | 資産          |           | 負債          |           |
|---------|-------------|-----------|-------------|-----------|
|         | 契約額等        | 時価        | 契約額等        | 時価        |
| オプション取引 | 6,728,808   | 273,079   | 6,919,202   | 272,733   |
| 為替予約取引  | 10,256,931  | 224,469   | 11,114,813  | 232,154   |
| スワップ取引  | 321,763,058 | 6,064,685 | 333,272,289 | 5,863,875 |
| 先物・先渡取引 | 1,114,627   | 44,723    | 601,618     | 17,058    |

(注) 1. 時価ならびにみなし決済損益を貸借対照表に計上しておりますので、評価損益欄を設けておりません。

2. 法的に有効なマスターネットティング契約を有する同一相手先に対する金利スワップ等のデリバティブ取引額、5,863,272百万円については、貸借対照表上相殺して表示しております。

3. 時価の算定方法は、金融商品取引所等の基準値段もしくは清算値段、または見積将来キャッシュ・フローの割引現在価値等を用い算定しております。

### (4) 約定見返勘定、(5) 信用取引資産

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

### (6) 有価証券担保貸付金

有価証券貸借取引および現先取引に伴う取引相手先への貸付金額が計上されております。また、受入れた有価証券の時価の変動により貸付金額の調整を行っていることや短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

### (7) 立替金、(8) 短期差入保証金、(9) 短期貸付金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(注) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

|              | 1年以内      |
|--------------|-----------|
| (1)現金・預金     | 1,230,534 |
| (2)預託金       | 16,642    |
| (5)信用取引資産    | 215,875   |
| (6)有価証券担保貸付金 | 6,326,190 |
| (7)立替金       | 1,589     |
| (8)短期差入保証金   | 1,380,898 |
| (9)短期貸付金     | 2,844     |
| 合計           | 9,174,572 |

#### 負債

(1)トレーディング商品

資産(3)トレーディング商品に記載しております。

(2)信用取引負債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(3)有価証券担保借入金

有価証券貸借取引および現先取引に伴う取引相手先からの借入金額が計上されております。また、差入れた有価証券の時価の変動により借入金額の調整を行っていることや短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(4)預り金、(5)受入保証金、(6)短期借入金、(7)関係会社短期借入金、(8)未払金、(9)一年以内償還社債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(10) 社債

当社の発行する社債の時価は、債券標準価格（JSプライス）を採用しております。

(11) 長期借入金、(12) 関係会社長期借入金

これらの長期借入金は、一定の期間ごとに区分した当該長期借入金の元利金の合計額を同様の借入において想定される利率で割り引いて現在価値を算定しております。

(注) 社債、借入金およびその他の有利子負債等の返済予定額

(単位：百万円)

|               | 1 年以内     | 1 年超<br>2 年以内 | 2 年超<br>3 年以内 | 3 年超<br>4 年以内 | 4 年超<br>5 年以内 | 5 年超    |
|---------------|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------|
| (2)信用取引負債     | 75,382    | —             | —             | —             | —             | —       |
| (3)有価証券担保借入金  | 5,221,154 | —             | —             | —             | —             | —       |
| (4)預り金        | 537,589   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (5)受入保証金      | 802,672   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (6)短期借入金      | 433,500   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (7)関係会社短期借入金  | 695,983   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (8)未払金        | 17,803    | —             | —             | —             | —             | —       |
| (9)一年以内償還社債   | 49,200    | —             | —             | —             | —             | —       |
| (10)社債        | —         | —             | —             | —             | —             | 4,700   |
| (11)長期借入金     | —         | 150,487       | 96,094        | 57,000        | 16,400        | 432,699 |
| (12)関係会社長期借入金 | —         | 75,000        | 100,000       | —             | 75,000        | —       |
| 合計            | 7,833,283 | 225,487       | 196,094       | 57,000        | 91,400        | 437,399 |

#### ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

親会社等の発行する社債等の金利変動リスクを親会社等がヘッジする目的で、当社は当該親会社等および第三者とスワップ取引を行っておりますが、その契約額等および時価は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

| 区分        | デリバティブ取引の種類等 | 契約額等      |         | 時価      | 評価損益    |
|-----------|--------------|-----------|---------|---------|---------|
|           |              |           | うち1年超   |         |         |
| 市場取引以外の取引 | 金利スワップ取引     |           |         |         |         |
|           | 受取固定・支払変動    | 1,019,050 | 845,550 | 27,928  | 27,928  |
|           | 支払固定・受取変動    | 1,019,050 | 845,550 | △27,928 | △27,928 |

#### ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、決算日における契約額または契約において定められた元本相当額等は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

| ヘッジ会計の方法 | デリバティブ取引の種類等          | 主なヘッジ対象 | 契約額等   |        | 時価  | 当該時価の算定方法 |
|----------|-----------------------|---------|--------|--------|-----|-----------|
|          |                       |         |        | うち1年超  |     |           |
| 原則的処理方法  | 金利スワップ取引<br>受取固定・支払変動 | 社債      | 49,200 | —      | 757 | 当社時価評価モデル |
| 原則的処理方法  | 金利スワップ取引<br>受取固定・支払変動 | 長期借入金   | 10,000 | 10,000 | 273 | 当社時価評価モデル |

当事業年度（2018年3月31日）

（単位：百万円）

|                           | 貸借対照表計上額   | 時価         | 差額     |
|---------------------------|------------|------------|--------|
| (1)現金・預金                  | 961,058    | 961,058    | —      |
| (2)預託金                    | 18,042     | 18,042     | —      |
| (3)トレーディング商品              | 3,469,388  | 3,469,388  | —      |
| 商品有価証券等                   | 2,689,328  | 2,689,328  | —      |
| デリバティブ取引                  | 780,060    | 780,060    | —      |
| (4)約定見返勘定                 | 450,274    | 450,274    | —      |
| (5)信用取引資産                 | 271,989    | 271,989    | —      |
| 信用取引貸付金                   | 264,818    | 264,818    | —      |
| 信用取引借証券担保金                | 7,171      | 7,171      | —      |
| (6)有価証券担保貸付金              | 6,025,130  | 6,025,130  | —      |
| 借入有価証券担保金                 | 5,482,432  | 5,482,432  | —      |
| 現先取引貸付金                   | 542,698    | 542,698    | —      |
| (7)立替金                    | 3,320      | 3,320      | —      |
| (8)短期差入保証金                | 1,514,331  | 1,514,331  | —      |
| (9)短期貸付金                  | 2,241      | 2,241      | —      |
| 資産計                       | 12,715,773 | 12,715,773 | —      |
| (1)トレーディング商品              | 3,048,477  | 3,048,477  | —      |
| 商品有価証券等                   | 2,521,508  | 2,521,508  | —      |
| デリバティブ取引                  | 526,970    | 526,970    | —      |
| (2)信用取引負債                 | 59,379     | 59,379     | —      |
| 信用取引借入金                   | 3,799      | 3,799      | —      |
| 信用取引貸証券受入金                | 55,581     | 55,581     | —      |
| (3)有価証券担保借入金              | 5,129,050  | 5,129,050  | —      |
| 有価証券貸借取引受入金               | 1,263,508  | 1,263,508  | —      |
| 現先取引借入金                   | 3,865,541  | 3,865,541  | —      |
| (4)預り金                    | 562,315    | 562,315    | —      |
| (5)受入保証金                  | 861,503    | 861,503    | —      |
| (6)短期借入金                  | 490,719    | 490,719    | —      |
| (7)関係会社短期借入金              | 705,041    | 705,041    | —      |
| (8)短期社債                   | 173,000    | 173,000    | —      |
| (9)未払金                    | 15,295     | 15,295     | —      |
| (10)社債                    | 4,700      | 5,552      | 852    |
| (11)長期借入金                 | 689,651    | 684,669    | △4,982 |
| (12)関係会社長期借入金             | 175,000    | 178,941    | 3,941  |
| 負債計                       | 11,914,130 | 11,913,940 | △190   |
| ヘッジ会計が適用されている<br>デリバティブ取引 |            |            |        |
| 資産                        | 93         | 93         | —      |
| 負債                        | —          | —          | —      |

## 資産

### (1) 現金・預金

満期のない預金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある預金については、当期末は該当ございません。

### (2) 預託金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

### (3) トレーディング商品（資産および負債）

商品有価証券等の時価は、一般的に市場取引価格、もしくは合理的な水準の価格客観性を持つ業者間取引価格、変数が直接観察可能な類似の金融商品を参照して得た価格に基づいております。商品有価証券等のなかには流動性の低い商品が含まれており、そのような商品に関しては当社による最善の見積公正価値を利用して価格決定がなされております。

デリバティブ取引は、上場デリバティブおよび店頭取引デリバティブで構成されております。上場デリバティブの時価は、市場取引価格または評価モデルによって決定されます。店頭取引デリバティブは、評価モデルを使用して価格評価がなされます。

#### ① 商品有価証券等の貸借対照表計上額

(単位：百万円)

| 種類      | 資産        | 負債        |
|---------|-----------|-----------|
| 株式・ワラント | 192,766   | 163,198   |
| 債券      | 2,311,677 | 2,328,782 |
| 受益証券等   | 184,886   | 29,528    |

(注) トレーディング損益に含まれた評価差額（益）は、2,635百万円であります。

#### ② デリバティブ取引の契約額および時価

(単位：百万円)

| 種類      | 資産          |           | 負債          |           |
|---------|-------------|-----------|-------------|-----------|
|         | 契約額等        | 時価        | 契約額等        | 時価        |
| オプション取引 | 6,104,178   | 258,009   | 5,829,323   | 251,157   |
| 為替予約取引  | 9,505,167   | 180,079   | 9,758,404   | 187,605   |
| スワップ取引  | 258,825,425 | 4,535,993 | 251,393,660 | 4,285,810 |
| 先物・先渡取引 | 942,163     | 21,521    | 833,549     | 17,939    |

(注) 1. 時価ならびにみなし決済損益を貸借対照表に計上しておりますので、評価損益欄を設けておりません。

2. 法的に有効なマスターネットティング契約を有する同一相手先に対する金利スワップ等のデリバティブ取引額、4,215,541百万円については、貸借対照表上相殺して表示しております。

3. 時価の算定方法は、金融商品取引所等の基準値段もしくは清算値段、または見積将来キャッシュ・フローの割引現在価値等を用い算定しております。

### (4) 約定見返勘定、(5) 信用取引資産

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

### (6) 有価証券担保貸付金

有価証券貸借取引および現先取引に伴う取引相手先への貸付金額が計上されております。受入れた有価証券の時価の変動により貸付金額の調整を行っていることや短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

### (7) 立替金、(8) 短期差入保証金、(9) 短期貸付金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(注) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

|               | 1年以内      |
|---------------|-----------|
| (1) 現金・預金     | 961,058   |
| (2) 預託金       | 18,042    |
| (5) 信用取引資産    | 271,989   |
| (6) 有価証券担保貸付金 | 6,025,130 |
| (7) 立替金       | 3,320     |
| (8) 短期差入保証金   | 1,514,331 |
| (9) 短期貸付金     | 2,241     |
| 合計            | 8,796,111 |

#### 負債

(1) トレーディング商品

資産(3) トレーディング商品に記載しております。

(2) 信用取引負債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(3) 有価証券担保借入金

有価証券貸借取引および現先取引に伴う取引相手先からの借入金額が計上されております。また、差入れた有価証券の時価の変動により借入金額の調整を行っていることや短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(4) 預り金、(5) 受入保証金、(6) 短期借入金、(7) 関係会社短期借入金、(9) 未払金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格によっております。

(8) 短期社債、(10) 社債

当社の発行する社債の時価は、債券標準価格（JSプライス）を採用しております。

(11) 長期借入金、(12) 関係会社長期借入金

これらの長期借入金は、一定の期間ごとに区分した当該長期借入金の元利金の合計額を同様の借入において想定される利率で割り引いて現在価値を算定しております。

(注) 社債、借入金およびその他の有利子負債等の返済予定額

(単位：百万円)

|               | 1 年以内     | 1 年超<br>2 年以内 | 2 年超<br>3 年以内 | 3 年超<br>4 年以内 | 4 年超<br>5 年以内 | 5 年超    |
|---------------|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------|
| (2)信用取引負債     | 59,379    | —             | —             | —             | —             | —       |
| (3)有価証券担保借入金  | 5,129,050 | —             | —             | —             | —             | —       |
| (4)預り金        | 562,315   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (5)受入保証金      | 861,503   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (6)短期借入金      | 490,719   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (7)関係会社短期借入金  | 705,041   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (8)短期社債       | 173,000   | —             | —             | —             | —             | —       |
| (9)未払金        | 15,295    | —             | —             | —             | —             | —       |
| (10)社債        | —         | —             | —             | —             | —             | 4,700   |
| (11)長期借入金     | —         | 88,810        | 47,000        | 17,400        | 25,500        | 510,942 |
| (12)関係会社長期借入金 | —         | 100,000       | —             | 75,000        | —             | —       |
| 合計            | 7,996,302 | 188,810       | 47,000        | 92,400        | 25,500        | 515,642 |

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、決算日における契約額または契約において定められた元本相当額等は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

| ヘッジ会計<br>の方法 | デリバティブ取引の種<br>類等      | 主なヘッジ対象 | 契約額等   |       | 時価 | 当該時価の算<br>定方法 |
|--------------|-----------------------|---------|--------|-------|----|---------------|
|              |                       |         |        | うち1年超 |    |               |
| 原則的処理<br>方法  | 金利スワップ取引<br>受取固定・支払変動 | 短期借入金   | 10,000 | —     | 93 | 当社時価評価<br>モデル |

[関連当事者との取引に関する注記]

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

1. 親会社および法人主要株主等

(単位：百万円)

| 属性  | 会社等の名称             | 議決権等の所有<br>(被所有) 割合 | 関連当事者との関係                | 取引の内容                             | 取引金額      | 科目            | 期末残高    |
|-----|--------------------|---------------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------|---------------|---------|
| 親会社 | 野村ホールディングス<br>株式会社 | (被所有)<br>直接100%     | 諸設備の利用<br>資金の借入<br>役員の兼任 | 情報処理システム<br>利用料の支払                | 105,308   | 未払費用          | 16,483  |
|     |                    |                     |                          | 資金の借入                             | 1,021,637 | 関係会社短期借<br>入金 | 695,983 |
|     |                    |                     |                          | 利息の支払                             | 13,632    | 未払費用          | 383     |
|     |                    |                     |                          | 劣後特約付コミ<br>ットメントライ<br>ンの設定        | 700,000   | 関係会社長期借<br>入金 | 250,000 |
|     |                    |                     |                          | 資金の借入<br>コミットメント<br>ライン設定料の<br>支払 | —<br>900  | —             | —       |

取引条件および取引条件の決定方針等

情報処理システム利用料につきましては、親会社の原価を基準として合理的に決定しております。

資金の借入につきましては、借入利率は市場金利を勘案して合理的に決定しております。なお、担保は差し入れておりません。また、取引金額および期末残高から劣後特約付コミットメントラインの設定にかかる取引を除いております。

劣後特約付コミットメントラインの設定における取引金額は融資限度額であり、期末日現在の融資実行残高は250,000百万円であります。

(注) 取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。



## 2. 兄弟会社等

(単位：百万円)

| 属性      | 会社等の名称                                    | 議決権等の所有<br>(被所有) 割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容           | 取引金額               | 科目        | 期末残高     |
|---------|-------------------------------------------|---------------------|-----------|-----------------|--------------------|-----------|----------|
| 親会社の子会社 | ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス<br>N.V.                  | なし                  | 債務保証      | 保証金の受入          | 793,660            | 受入保証金     | 67,830   |
|         |                                           |                     |           | 保証金の返還          | 819,520            | —         | —        |
|         |                                           |                     |           | 利息の支払           | 15                 | 未払費用      | 0        |
|         |                                           |                     |           | 債務保証<br>保証料の受入  | 43,693<br>27       | —<br>未収収益 | —<br>10  |
| 親会社の子会社 | ノムラ・インター<br>ナショナルPLC                      | なし                  | 債務保証      | 債務保証            | 99,899             | —         | —        |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入          | 277                | 未収収益      | 153      |
|         |                                           |                     |           | 保証金の返還          | 3,694,374          | 差入保証金     | 452,464  |
|         |                                           |                     |           | 保証金の差入<br>利息の受取 | 3,557,449<br>8,177 | —<br>未収収益 | —<br>799 |
| 親会社の子会社 | ノムラ・バンク・<br>インターナショナル<br>PLC              | なし                  | 債務保証      | 債務保証            | 18,018             | —         | —        |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入          | 15                 | 未収収益      | 7        |
| 親会社の子会社 | ノムラ・グローバ<br>ル・ファイナンシ<br>ヤル・プロダクツ<br>Inc.  | なし                  | 債務保証      | 債務保証            | 13,195             | —         | —        |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入          | 43                 | 未収収益      | 24       |
|         |                                           |                     |           | 保証金の返還          | 393,378            | 差入保証金     | 5,770    |
|         |                                           |                     |           | 保証金の差入<br>利息の支払 | 483,833<br>73      | —<br>未払費用 | —<br>1   |
| 親会社の子会社 | ノムラ・インター<br>ナショナル・ファ<br>ンディングPte.<br>Ltd. | なし                  | 債務保証      | 債務保証            | 59,581             | —         | —        |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入          | 43                 | 未収収益      | 24       |

### 取引条件および取引条件の決定方針等

ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンスN.V.からの受入保証金は、スワップ取引等の評価益相当分を担保として受入れたものであります。ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンスN.V.に対する債務保証は、同社が発行するミディアム・ターム・ノートの元利金について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.02%の保証料を徴求しております。

ノムラ・インターナショナルPLCに対する債務保証は、同社のデリバティブ取引等について当社が債務を保証したものであり、保証額に対してレポ取引は年率0.04%、デリバティブ取引等は年率0.0625%～0.125%の保証料を徴求しております。またノムラ・インターナショナルPLCへの差入保証金は、スワップ取引等の評価損相当分を担保として差し入れたものであります。

ノムラ・バンク・インターナショナルPLCに対する債務保証は、同社が発行するミディアム・ターム・ノートの元利金について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.04%の保証料を徴求しております。

ノムラ・グローバル・ファイナンシャル・プロダクツInc.からの差入保証金は、スワップ取引等の評価損相当分を担保として差し入れたものであります。ノムラ・グローバル・ファイナンシャル・プロダクツInc.に対する債務保証は、同社のスワップ取引等について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.0625%～0.125%の保証料を徴求しております。

ノムラ・インターナショナル・ファンディングPte. Ltd.に対する債務保証は、同社が発行するミディアム・ターム・ノートの元利金について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.04%の保証料を徴求しております。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 親会社および法人主要株主等

（単位：百万円）

| 属性  | 会社等の名称             | 議決権等の所有<br>（被所有）割合 | 関連当事者との関係                | 取引の内容                      | 取引金額    | 科目            | 期末残高    |
|-----|--------------------|--------------------|--------------------------|----------------------------|---------|---------------|---------|
| 親会社 | 野村ホールディングス<br>株式会社 | （被所有）<br>直接100%    | 諸設備の利用<br>資金の借入<br>役員の兼任 | 情報処理システム<br>利用料の支払         | 113,858 | 未払費用          | 16,442  |
|     |                    |                    |                          | 資金の借入                      | 667,517 | 関係会社短期借<br>入金 | 705,041 |
|     |                    |                    |                          | 利息の支払                      | 8,899   | 未払費用          | 1,652   |
|     |                    |                    |                          | 劣後特約付コミ<br>ットメントライ<br>ンの設定 | 700,000 | 関係会社長期借<br>入金 | 175,000 |
|     |                    |                    |                          | 資金の借入                      | —       |               |         |
|     |                    |                    |                          | コミットメント<br>ライン設定料の<br>支払   | 902     | —             | —       |

取引条件および取引条件の決定方針等

情報処理システム利用料につきましては、親会社の原価を基準として合理的に決定しております。

資金の借入につきましては、借入利率は市場金利を勘案して合理的に決定しております。なお、担保は差し入れておりません。

上記の劣後特約付コミットメントラインの設定における取引金額は、融資限度額を示しております。

（注） 取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 兄弟会社等

(単位：百万円)

| 属性      | 会社等の名称                                    | 議決権等の所有<br>(被所有) 割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容  | 取引金額      | 科目    | 期末残高    |
|---------|-------------------------------------------|---------------------|-----------|--------|-----------|-------|---------|
| 親会社の子会社 | ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス<br>N.V.                  | なし                  | 債務保証      | 保証金の受入 | 517,030   | 受入保証金 | 74,240  |
|         |                                           |                     |           | 保証金の返還 | 510,620   | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 利息の支払  | 2         | 未払費用  | 0       |
|         |                                           |                     |           | 債務保証   | 36,400    | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入 | 8         | 未収収益  | 8       |
|         |                                           |                     |           | 利息の受取  | 8         | 未収収益  | 4       |
| 親会社の子会社 | ノムラ・インター<br>ナショナルPLC                      | なし                  | 債務保証      | 債務保証   | 119,068   | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入 | 108       | 未収収益  | 112     |
|         |                                           |                     |           | 保証金の返還 | 3,045,473 | 差入保証金 | 564,094 |
|         |                                           |                     |           | 保証金の差入 | 3,068,016 | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 利息の受取  | 7,165     | 未収収益  | 325     |
| 親会社の子会社 | ノムラ・バンク・<br>インターナショナル<br>PLC              | なし                  | 債務保証      | 債務保証   | 8,025     | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入 | 5         | 未収収益  | 5       |
| 親会社の子会社 | ノムラ・グロー<br>バル・ファイナンシ<br>ャル・プロダクツ<br>Inc.  | なし                  | 債務保証      | 債務保証   | 37,359    | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入 | 26        | 未収収益  | 27      |
|         |                                           |                     |           | 保証金の返還 | 480,098   | 差入保証金 | 61,493  |
|         |                                           |                     |           | 保証金の差入 | 535,821   | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 利息の支払  | 28        | 未払費用  | 3       |
| 親会社の子会社 | ノムラ・インター<br>ナショナル・ファン<br>ディングPte.<br>Ltd. | なし                  | 債務保証      | 債務保証   | 64,414    | —     | —       |
|         |                                           |                     |           | 保証料の受入 | 26        | 未収収益  | 26      |

### 取引条件および取引条件の決定方針等

ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンスN.V.からの受入保証金は、スワップ取引等の評価益相当分を担保として受入れたものであります。ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンスN.V.に対する債務保証は、同社が発行するミディアム・ターム・ノートの元利金について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.02%の保証料を徴求しております。

ノムラ・インターナショナルPLCに対する債務保証は、同社のデリバティブ取引等について当社が債務を保証したものであり、保証額に対してデリバティブ取引等は年率0.0625%～0.125%の保証料を徴求しております。またノムラ・インターナショナルPLCへの差入保証金は、スワップ取引等の評価損相当分を担保として差し入れたものであります。

ノムラ・バンク・インターナショナルPLCに対する債務保証は、同社が発行するミディアム・ターム・ノートの元利金について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.04%の保証料を徴求しております。

ノムラ・グローバル・ファイナンシャル・プロダクツInc.への差入保証金は、スワップ取引等の評価損相当分を担保として差し入れたものであります。ノムラ・グローバル・ファイナンシャル・プロダクツInc.に対する債務保証は、同社のスワップ取引等について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.0625%～0.125%の保証料を徴求しております。

ノムラ・インターナショナル・ファンディングPte. Ltd.に対する債務保証は、同社が発行するミディアム・ターム・ノートの元利金について当社が債務を保証したものであり、保証額に対して年率0.04%の保証料を徴求しております。

[1株当たり情報に関する注記]

| 前事業年度<br>(自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日) |               | 当事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) |               |
|----------------------------------------|---------------|----------------------------------------|---------------|
| 1株当たり純資産額                              | 3,654,065円84銭 | 1株当たり純資産額                              | 3,285,628円80銭 |
| 1株当たり当期純利益                             | 356,204円10銭   | 1株当たり当期純利益                             | 379,519円63銭   |

[重要な後発事象に関する注記]

該当事項はありません。

[その他の注記]

当社の顧客口座数は約532万口座に及びます。当社の顧客との多くの取引において、顧客の投資損失等をめぐっての係争が、場合によっては訴訟になることがあります。その中には、2014年10月に法人顧客より提起された2006年から2012年にかけて行われた為替デリバティブ取引により発生した損失額等の2,143百万円の損害賠償を求めるものが含まれます。この訴訟の顧客は、取引契約時点における、当社による説明義務違反等を主張していますが、当社はこの顧客の主張には理由がないと考えております。

なお、2013年4月に法人顧客より提起された2005年から2011年にかけて行われた為替デリバティブ取引およびエクイティ関連の仕組債11銘柄の売却や償還により発生した損失額等の10,247百万円の損害賠償を求める訴訟については、2018年2月8日に当該顧客と和解し、当該訴訟は終了しました。

当社は役員および従業員に対し、当事業年度の末日後に、野村ホールディングス株式会社の株価および業績等に連動した報酬を支給する予定です。

## ２．借入金の主要な借入先及び借入金額

### (1) 2017年3月31日現在

(単位：百万円)

| 借入先            | 借入金の種類    | 借入金の残高  |
|----------------|-----------|---------|
| 野村ホールディングス株式会社 | 短期借入金     | 695,983 |
|                | 短期借入金（劣後） | —       |
|                | 長期借入金（劣後） | 250,000 |
| 日本銀行           | 短期借入金     | 30,000  |
| 農林中央金庫         | 長期借入金（劣後） | 100,000 |

(注) 日本銀行からの「短期借入金」は、日本銀行に当社保有の債券を担保として差し入れて電子貸付を受ける、日本銀行が資金を供給するオペレーションによるものであります。

### (2) 2018年3月31日現在

(単位：百万円)

| 借入先            | 借入金の種類    | 借入金の残高  |
|----------------|-----------|---------|
| 野村ホールディングス株式会社 | 短期借入金     | 630,041 |
|                | 短期借入金（劣後） | 75,000  |
|                | 長期借入金（劣後） | 175,000 |
| 日本銀行           | 短期借入金     | 40,000  |
| 農林中央金庫         | 短期借入金（劣後） | 100,000 |
| 日本政策投資銀行       | 短期借入金     | 30,000  |

(注) 日本銀行からの「短期借入金」は、日本銀行に当社保有の債券を担保として差し入れて電子貸付を受ける、日本銀行が資金を供給するオペレーションによるものであります。

## ３．保有する有価証券（トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く）の取得価額、時価及び評価損益

### (1) 満期保有目的債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

### (2) 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

### (3) その他有価証券で時価のあるもの

該当事項はありません。

### (4) 事業年度中に売却した満期保有目的債券

該当事項はありません。

(5) 事業年度中に売却したその他有価証券  
該当事項はありません。

(6) 時価評価されていない主な有価証券（上記(1)，(2)を除く）  
該当事項はありません。

(7) その他有価証券のうち満期があるものの償還予定額  
該当事項はありません。

4. デリバティブ取引（トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く）の契約価額、時価及び評価損益  
金融商品に関する注記をご参照ください。

5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無

2017年3月期（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）の財務諸表は、会社法436条第2項第1号の規定に基づき、EY新日本有限責任監査法人より適正意見が表明されております。また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、同監査法人の監査も受けており、同監査法人より適正意見が表明されております。

2018年3月期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）の財務諸表は、会社法436条第2項第1号の規定に基づき、EY新日本有限責任監査法人より適正意見が表明されております。

（注）EY新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日付で新日本有限責任監査法人から名称変更しております。

## IV. 管理の状況

### 1. 内部管理の状況の概要

当社は、法令諸規則を遵守した業務活動の遂行を確保するために、内部管理体制の強化および拡充に努めてきております。

#### 内部管理委員会

当社は、内部管理体制の整備・点検およびコンプライアンス・ルールに関する事項ならびに内部管理上の重要事項に係る審議を行うことを目的として「内部管理委員会」を設置しております。

本委員会は、当社役員および当社のリーガル・スーパーバイザーを委嘱する弁護士から構成され、議長を代表執行役社長が務めております。

リーガル・スーパーバイザーには、審議の内容および結果について、その適法性のみならず社会的妥当性の観点からもチェックを受けております。

#### 部店における内部管理体制

当社は、日本証券業協会の規則に基づいて、営業部店に「内部管理責任者」を配置しております。内部管理責任者は、金融商品取引法その他の法令諸規則等を遵守した営業活動が行われるよう所属部店の業務状況を管理するとともに、部店内における営業活動に重大な事案が生じた場合には、代表執行役常務である内部管理統括責任者に報告し、その指示を受けるものとしております。

また、全部店を対象として遵法精神の啓発と法令諸規則等を遵守した業務運営を推進する役割を担う者として、部店長や内部管理責任者とは別に、「業務管理者」を配置しております。業務管理者は、所属部店の業務状況を把握し、部店内において発生した法令遵守上の重要事案について管理部門等に報告するとともに、法令諸規則の周知とその運営に係る指導を行っております。

営業部店においては、管理部門と連絡をとりながら、社員の法令遵守状況の監視や事故の未然防止の観点から、営業姿勢等の具体的管理手法として、部店長主催のもと、全管理職が出席して取引管理上の問題点および改善策を討議する形式で、管理会議を定期的開催することとしております。また、2016年度より、行動管理、人事労務管理、コンプライアンス、業務遂行状況等をテーマとして、部店長主催のもと、営業組織の管理職と総務課長（内部管理責任者）が出席して、営業社員固有の問題を検討するための会議を定期的開催することとしております。

なお、日々顧客と接する社員の業務遂行上の姿勢のあり方を示すため、社員の行動規範として、個々の取引ルールとは別に、「野村グループ 倫理規程」を定めております。

#### 管理部門

当社は、業務管理本部としてコンプライアンス統括部、リテール業務管理部、取引コンプライアンス部、検査部、審理部およびマネー・ロンダリング対策室の6部を配置し、日常の業務活動に係る指導や監視を行うとともに、法令諸規則の遵守について本社関連各部と協力しつつ、部店長、内部管理責任者、業務管理者をはじめとした社員全般への教育・研修を定期的に行っております。

#### 金融先物取引内部管理責任者

当社は、金融先物取引業協会の規則に基づいて、執行部門としてグローバル・マーケット企画部、ネット&コール部に、また、管理部門としてコンプライアンス統括部およびリテール業務管理部に、それぞれ「金融先物取引内部管理責任者」を配置しております。金融先物取引内部管理責任者は、金融先物取引業務が、金融商品取引法その他法令諸規則等を遵守して、適正に行われているか管理を行うとともに、金融先物取引の営業活動、取引の執行、顧客管理その他の金融先物取引業務に関し、重大な事案が生じた場合には、金融先物取引内部管理担当役員（当社の執行役のうち、当社における金融先物取引業務の内部管理を担当する者として金融先物取引業協会に登録された者）に報告し、その指示を受けるものとしております。

#### お客様からのご意見および苦情のお取り扱いについて

当社では幅広くお客様の声をおうかがいできるよう専用フリーダイヤル「ご意見・苦情ダイヤル」を設けております。お客様相談室は、営業店、フリーダイヤル、本社宛の手紙・メールなどを經由して寄せられるお客様の声を真摯に受け止め、苦情等については、営業店への対応要請と助言・指導を行っています。また、苦情ならびにご意見・ご要望について集約、内容を分析し、経営への報告と関連部署への連携を行い業務運営の見直しや制度・システムの改善を図っています。これからもお客様本位の観点に立ち、こうした取り組みを継続することにより、お客様の当社に対する満足度を高め、より深い信頼が得られるようにしていきたいと考えています。

## 内部監査体制

内部統制の有効性および妥当性を確保するため、業務執行から独立したインターナル・オーディット部を設置し、当社における内部監査を実施しております。内部監査の結果については、経営会議、監査委員会ならびに監査特命取締役に対して報告が行われております。

## 2. 分別管理等の状況

### (1) 顧客資産の分別管理（金融商品取引法第43条の2）

1998年12月1日に施行された金融商品取引法（旧証券取引法）の改正により、投資者保護基金が設立され、証券会社への加入が義務付けられるとともに、1999年4月1日より証券会社の自己資産とお客様のお預り資産を明確に区分して保管する「顧客資産の分別管理」が義務付けられました。当社におきましても、上記法制化を受けまして、金融商品取引法、日本投資者保護基金、金融商品取引所、日本証券業協会等の諸規則に基づき、以下のとおり「顧客資産の分別管理」を行っており、お客様のお預り資産を、確実に保全しています。

また、当社では、EY新日本有限責任監査法人に、日本公認会計士協会が定める業種別委員会実務指針第54号に準拠した「顧客資産の分別管理の法令遵守に関する保証業務」を依頼しております。2018年3月31日現在において当社は、顧客資産の分別管理に関する経営者報告書における経営者の主張が、全ての重要な点において法令及び規則に準拠して記載されているものと認められる主旨の保証報告書を、同監査法人より受領しています。

詳しくはこちらへ⇒[https://www.nomura.co.jp/introduc/news/2018/20180612\\_1.html](https://www.nomura.co.jp/introduc/news/2018/20180612_1.html)

### ① 顧客分別金信託の状況

(単位：百万円)

| 項目                 | 2017年3月31日現在 | 2018年3月31日現在 |
|--------------------|--------------|--------------|
| 直近差替計算基準日の顧客分別金必要額 | 627,645      | 662,145      |
| 顧客分別金信託額           | 638,565      | 674,119      |
| 期末日現在の顧客分別金必要額     | 576,966      | 629,172      |

(注) お客様よりお預りしている金銭は、「顧客分別金」として取扱い、当社自身の金銭とは区別して、信託銀行に信託しています。例えば、次のような金銭を「顧客分別金」として取り扱っています。

- ・有価証券の買付けに伴いお客様よりお預りした現金で、有価証券の受渡が行われるまでのもの
- ・受渡日を過ぎたご売却代金・配当金・分配金・利子・償還金等で、当社の預り金となったまま、お客様が受け取られていないもの

(注) 顧客分別金信託額は、直近の差替計算基準日における顧客分別金必要額に基づき算出しています。

### ② 有価証券の分別管理の状況

#### (イ) 保護預り等有価証券

| 有価証券の種類 | 2017年3月31日現在  |              | 2018年3月31日現在  |              |
|---------|---------------|--------------|---------------|--------------|
|         | 国内有価証券        | 外国有価証券       | 国内有価証券        | 外国有価証券       |
| 株券      | 59,748,744千株  | 3,142,428千株  | 44,789,948千株  | 3,930,146千株  |
| 債券      | 12,956,519百万円 | 7,195,179百万円 | 13,099,053百万円 | 7,335,447百万円 |
| 受益証券    | 18,443,893百万口 | 705,679百万口   | 18,001,468百万口 | 717,953百万口   |
| 新株予約権証券 | —             | 26,799個      | —             | 12,541個      |
| その他     | 42,439百万円     | —            | 33,410百万円     | —            |



## (ロ) 受入保証金代用有価証券

| 有価証券の種類 | 2017年3月31日現在 |           | 2018年3月31日現在 |          |
|---------|--------------|-----------|--------------|----------|
|         | 国内有価証券       | 外国有価証券    | 国内有価証券       | 外国有価証券   |
| 株券      | 249,357千株    | 21千株      | 203,677千株    | 192千株    |
| 債券      | 679百万円       | 19,241百万円 | 928百万円       | 6,042百万円 |
| 受益証券    | 42,239百万口    | 2百万口      | 41,042百万口    | 2百万口     |
| その他     | 1,252百万円     | —         | 1,096百万円     | —        |

## (ハ) 有価証券の管理の状況

お客様よりお預りしている有価証券は、当社の証券取引約款および外国証券取引口座約款に基づいて以下の保管形態で「分別保管」しています。

| 有価証券区分     | 当社の保管形態                                                                |
|------------|------------------------------------------------------------------------|
| 国内株式       | 原則として、株式会社証券保管振替機構で管理しています。                                            |
| 国内債券       | 原則として、株式会社証券保管振替機構で管理しています。                                            |
| 国内投資信託受益証券 | また、振替決済の対象とならない保護預り証券については、特にお申し出のない限り、他のお客様の同銘柄の証券と混蔵して保管することがあります。   |
| 外国証券       | 海外の保管機関において、混蔵して保管しています（現地保管機関の国内の諸法令および慣行ならびに現地保管機関の諸規則等に従って管理しています）。 |
| 株式累積投資     | 他のお客様との寄託契約により保管する同銘柄の有価証券と混蔵して保管いたします（当該株式等を株式会社証券保管振替機構で管理しています）。    |

(注) 混蔵して保管する場合の「分別保管」とは当社の帳簿等により、お客様からお預りしている有価証券と、その他の有価証券（当社所有の有価証券）とを区分管理し、お客様ごとの持ち分が直ちに判別できるように保管することです。

## (2) 有価証券関連店頭デリバティブ取引等の分別管理（金融商品取引法第43条の2）

証券会社は有価証券関連店頭デリバティブ取引に係る証拠金等について、分別管理を義務付けられています（金融商品取引法第43条の2）。当社でも、対象取引につき、証拠金等を信託銀行に信託しています。当該分別管理は、上述の「顧客資産の分別管理の法令遵守に関する保証業務」の対象です。

有価証券関連店頭デリバティブ取引等の分別管理の状況（2018年3月31日現在）

（単位：百万円）

|    | 管理の方法  | 当期末残高 | 前期末残高 | 内訳         |
|----|--------|-------|-------|------------|
| 金銭 | 特定金銭信託 | 600   | 400   | 野村信託銀行株式会社 |

(注) 本特定金銭信託の残高は後記(3)①の特定金銭信託の残高に含まれています。

(3) 通貨関連デリバティブ取引等の区分管理（金融商品取引法第43条の3）

お客様よりお預りしている通貨関連デリバティブ取引等（外国為替証拠金取引など）にかかる預託証拠金については、お客様よりお預りした金銭であることを明確にし、自己の固有財産と区分して管理することが義務付けられています。金銭については信託銀行へ信託しています。

また、預託証拠金の時価評価額（未決済建玉にかかる評価損益およびスワップ損益、ならびに未受渡建玉にかかる損益およびスワップ損益を含みます。）についても、上述の金銭信託により信託しています。

① 金融商品取引法第43条の3第1項の規定に基づく区分管理の状況

|       |      | 管理の方法    | 当期末残高     | 前期末残高     | 内訳                         |
|-------|------|----------|-----------|-----------|----------------------------|
| 金銭    |      | 特定金銭信託   | 17,900百万円 | 16,500百万円 | 野村信託銀行株式会社                 |
| 有価証券等 | 株式   | 第三者による管理 | 9,968千株   | 13,128千株  | 株式会社証券保管振替機構               |
|       | 投資信託 | 第三者による管理 | 1百万口      | 1百万口      | ノムラ・バンク・ルクセンブルグ S. A.      |
|       |      |          | 1,190百万口  | 1,308百万口  | 株式会社証券保管振替機構               |
|       | 債券   | 第三者による管理 | 14百万USD   | 15百万USD   | ユーロクリア・バンク<br>S. A. /N. V. |
|       |      |          | 4,000百万円  | 17,000百万円 |                            |
|       |      |          | 3百万AUD    | 3百万AUD    |                            |
|       |      |          | 50百万円     | 50百万円     | ノムラ・バンク・ルクセンブルグ S. A.      |
|       |      |          | 335百万円    | 335百万円    | 日本銀行                       |
|       |      |          | 0百万USD    | 一百万USD    | バンク・オブ・ニューヨーク・メロン          |

② 金融商品取引法第43条の3第2項の規定に基づく区分管理の状況

該当事項はありません。

## V. 連結子会社等の状況に関する事項

### 1. 企業集団の構成

該当事項はありません。

### 2. 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等

該当事項はありません。

**野村證券**