

## 【表紙】

【提出書類】	四半期報告書の訂正報告書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条の4の7第4項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2021年6月30日
【四半期会計期間】	第117期第3四半期（自 2020年10月1日 至 2020年12月31日）
【会社名】	野村ホールディングス株式会社
【英訳名】	Nomura Holdings, Inc.
【代表者の役職氏名】	代表執行役社長 グループCEO 奥田 健太郎
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目13番1号
【電話番号】	03(5255)1000
【事務連絡者氏名】	主計部長 谷川 弘樹
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区大手町二丁目2番2号
【電話番号】	03(5255)1000
【事務連絡者氏名】	主計部長 谷川 弘樹
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1号） 株式会社名古屋証券取引所 （名古屋市中区栄三丁目8番20号）

## 1【四半期報告書の訂正報告書の提出理由】

2021年2月15日に提出いたしました第117期第3四半期（自 2020年10月1日 至 2020年12月31日）四半期報告書の記載事項の一部に誤りがありましたので、これを訂正するため四半期報告書の訂正報告書を提出するものであります。

## 2【訂正事項】

第一部 企業情報

第2 事業の状況

2 経営者による財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析

(3) トレーディング業務の概要

(6) 流動性資金調達と資本の管理

6. コンティンジェンシー・ファンディング・プラン

## 3【訂正箇所】

訂正箇所は\_\_\_\_\_を付して表示しております。

## 第一部【企業情報】

### 第2【事業の状況】

#### 2【経営者による財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

##### (3) トレーディング業務の概要

(訂正前)

トレーディング目的資産負債

トレーディング目的資産および負債の内訳については、「第4【経理の状況】1【四半期連結財務諸表】〔四半期連結財務諸表注記〕 2 公正価値測定および 3 デリバティブ商品およびヘッジ活動」をご参照ください。

トレーディングのリスク管理

野村はトレーディング業務におけるマーケット・リスクの測定方法として、バリュー・アット・リスク（以下「VaR」）を採用しております。

##### 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

	前連結会計年度末 (2020年3月31日) (億円)	当第3四半期連結会計期間末 (2020年12月31日) (億円)
株式関連	89	31
金利関連	223	85
為替関連	51	42
小計	363	158
分散効果	△110	△65
バリュー・アット・リスク (VaR)	253	93

	当第3四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年12月31日)		
	最大値 (億円) (1)	最小値 (億円) (1)	平均値 (億円) (1)
バリュー・アット・リスク (VaR)	270	70	139

(1) 過去9カ月のVaRの最大値、平均値、最小値は日次の計算結果に基づく。

(訂正後)

#### トレーディング目的資産負債

トレーディング目的資産および負債の内訳については、「第4 [経理の状況] 1 [四半期連結財務諸表] [四半期連結財務諸表注記] 2 公正価値測定および 3 デリバティブ商品およびヘッジ活動」をご参照ください。

#### トレーディングのリスク管理

野村はトレーディング業務におけるマーケット・リスクの測定方法として、バリュー・アット・リスク（以下「VaR」）を採用しております。

##### 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

	前連結会計年度末 (2020年3月31日) (億円)	当第3四半期連結会計期間末 (2020年12月31日) (億円)
株式関連	89	31
金利関連	223	85
為替関連	51	42
小計	363	158
分散効果	△110	△61
バリュー・アット・リスク (VaR)	253	97

	当第3四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年12月31日)		
	最大値 (億円) (1)	最小値 (億円) (1)	平均値 (億円) (1)
バリュー・アット・リスク (VaR)	270	71	142

(1) 過去9カ月のVaRの最大値、平均値、最小値は日次の計算結果に基づく。

(6) 流動性資金調達と資本の管理

6. コンティンジェンシー・ファンディング・プラン

(訂正前)

(省略)

当社は、川上連結告示第2条の算式に従い、普通株式等Tier1資本の額、Tier1資本（普通株式等Tier1資本およびその他Tier1資本）の額、総自己資本（Tier1資本およびTier2資本）の額、信用リスク・アセットの額、マーケット・リスク相当額およびオペレーショナル・リスク相当額をもとに連結自己資本規制比率を測定しております。2020年12月31日現在の野村の連結普通株式等Tier1比率（普通株式等Tier1資本の額をリスク・アセットの額で除した比率）は17.73%、連結Tier1比率（Tier1資本の額をリスク・アセットの額で除した比率）は19.86%、連結総自己資本規制比率（総自己資本の額をリスク・アセットの額で除した比率）は19.92%となり、川上連結告示の定める要件をそれぞれ満たしました。なお、2020年12月31日現在、川上連結告示の定める要件は、連結普通株式等Tier1比率について7.51%、連結Tier1比率について9.01%、連結総自己資本規制比率について11.01%となっております。

2020年12月31日現在の連結自己資本規制比率について、以下に示しております。

	(単位：億円)
	当第3四半期連結会計期間末 (2020年12月31日)
自己資本	
普通株式等Tier1資本の額	26,362
Tier1資本の額	29,529
総自己資本の額	29,612
リスク・アセット	
信用リスク・アセットの額	80,590
マーケット・リスク相当額を8%で除して得た値	<u>42,246</u>
オペレーショナル・リスク相当額を8%で除して得た値	25,781
リスク・アセット合計	<u><u>148,617</u></u>
連結自己資本規制比率	
連結普通株式等Tier1比率	<u>17.73%</u>
連結Tier1比率	<u>19.86%</u>
連結総自己資本規制比率	<u>19.92%</u>

(省略)

(訂正後)

(省略)

当社は、川上連結告示第2条の算式に従い、普通株式等Tier1資本の額、Tier1資本（普通株式等Tier1資本およびその他Tier1資本）の額、総自己資本（Tier1資本およびTier2資本）の額、信用リスク・アセットの額、マーケット・リスク相当額およびオペレーショナル・リスク相当額をもとに連結自己資本規制比率を測定しております。2020年12月31日現在の野村の連結普通株式等Tier1比率（普通株式等Tier1資本の額をリスク・アセットの額で除した比率）は17.60%、連結Tier1比率（Tier1資本の額をリスク・アセットの額で除した比率）は19.71%、連結総自己資本規制比率（総自己資本の額をリスク・アセットの額で除した比率）は19.77%となり、川上連結告示の定める要件をそれぞれ満たしました。なお、2020年12月31日現在、川上連結告示の定める要件は、連結普通株式等Tier1比率について7.51%、連結Tier1比率について9.01%、連結総自己資本規制比率について11.01%となっております。

2020年12月31日現在の連結自己資本規制比率について、以下に示しております。

(単位：億円)

	当第3四半期連結会計期間末 (2020年12月31日)
自己資本	
普通株式等Tier1資本の額	26,362
Tier1資本の額	29,529
総自己資本の額	29,612
リスク・アセット	
信用リスク・アセットの額	80,590
マーケット・リスク相当額を8%で除して得た値	<u>43,370</u>
オペレーショナル・リスク相当額を8%で除して得た値	25,781
リスク・アセット合計	<u><u>149,741</u></u>
連結自己資本規制比率	
連結普通株式等Tier1比率	<u>17.60%</u>
連結Tier1比率	<u>19.71%</u>
連結総自己資本規制比率	<u>19.77%</u>

(省略)

## 【表紙】

【提出書類】	確認書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条の4の8第1項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2021年6月30日
【会社名】	野村ホールディングス株式会社
【英訳名】	Nomura Holdings, Inc.
【代表者の役職氏名】	代表執行役社長 グループCEO 奥田 健太郎
【最高財務責任者の役職氏名】	執行役 財務統括責任者(CFO) 北村 巧
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目13番1号
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号) 株式会社名古屋証券取引所 (名古屋市中区栄三丁目8番20号)

## 1 【四半期報告書の記載内容の適正性に関する事項】

当社の代表執行役社長 グループCEOである奥田健太郎および執行役 財務統括責任者（CFO）である北村巧は、当社の第117期第3四半期（自 2020年10月1日 至 2020年12月31日）の四半期報告書の訂正報告書の記載内容が金融商品取引法令に基づき適正に記載されていることを確認しました。

## 2 【特記事項】

確認に当たり、特記すべき事項はありません。